

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	73

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§12 备查文件目录.....	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	银华量化智慧动力灵活配置混合
基金主代码	000062
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 25 日
基金管理人	银华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	84,591,942.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	综合使用多种量化策略指导资产配置和选股，在严格控制投资组合风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金在投资的过程中，将量化策略贯彻到资产配置和选股中。在大类资产配置过程中，本基金密切关注反映宏观经济走向的相关数据，包括货币供应量、流动性、先导行业景气度、库存周期、PMI、工业生产增速、通胀水平等。在此基础上，本基金运用量化模型对上述各项指标的时间序列与股票市场指数时间序列的领先、滞后关系进行检验，选出其中关系显著、稳定且符合经济学、金融学原理的指标，作为能较好判断股市预期表现的指标。</p> <p>此外，本基金还将通过量化的手段，对表征市场情绪和资金流向的诸多指标的时间序列与股票市场指数的时间序列的领先、滞后关系进行检验。这些指标包括基金平均仓位、期指高频数据、股票账户活跃度、分析师多空情绪等。</p> <p>在综合考虑上述两方面因素的基础上，本基金将对权益类资产、固定收益类资产和现金等各类金融资产的配置比例进行实时动态的调整，力求实现投资组合动态管理最优化。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，属于证券投资基金中风险和预期收益较高的品种，其风险和预期收益水

	平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
--	--------------------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	田青
	联系电话	(010)58163000	(010) 67595096
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	(010) 67595096
传真		(010)58163027	(010) 66275853
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办 公楼 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼长安兴融中心
邮政编码		100738	100033
法定代表人		王珠林	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	银华基金管理股份有限公司	北京市东城区东长安街 1 号东方广 场东方经贸城 C2 办公楼 15 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-10,732,441.02
本期利润	-7,003,940.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0747
本期加权平均净值利润率	-6.03%
本期基金份额净值增长率	-2.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	17,642,990.75
期末可供分配基金份额利润	0.2086
期末基金资产净值	102,234,933.62
期末基金份额净值	1.209
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-4.73%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.71%	1.11%	3.07%	0.32%	3.64%	0.79%
过去三个月	-5.18%	1.13%	1.49%	0.35%	-6.67%	0.78%
过去六个月	-2.81%	0.93%	3.13%	0.32%	-5.94%	0.61%
过去一年	-3.20%	0.77%	5.31%	0.37%	-8.51%	0.40%
自基金合同生效起至今	-4.73%	0.74%	5.98%	0.41%	-10.71%	0.33%

注：中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%

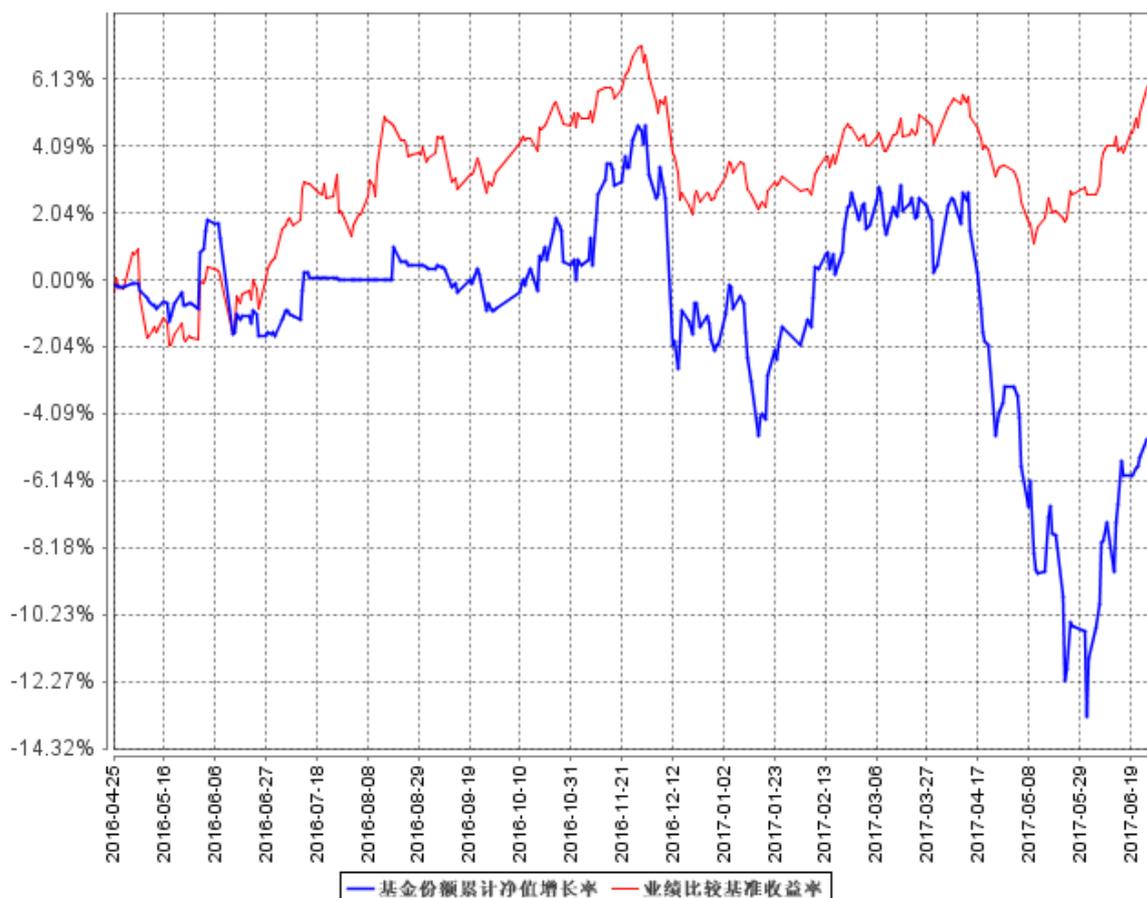
中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，从上海和深圳证券交易所中选取 800 只 A 股作为样本的综合性指数；样本选择标准为规模居前、流动性良好的股票，目前中证 800 指数样本覆盖了沪深市场近八成左右的市值，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，其选样是所有流通的符合指数设计原则的记帐式国债、央行票据和政策性银行债，是综合反映境内利率类债券整体价格走势情况的债券指数。

本基金是混合型基金，基金在运作过程中将维持 0%-95% 的股票资产，其余资产主要投资于权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具。因此，“中证 800 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%”是衡量本基金投资业绩的理想基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项

投资比例已达到基金合同的规定：本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。银华基金管理有限公司的法定名称已于 2016 年 8 月 9 日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 79 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选混合型证券投资基金、银华优质增长混合型证券投资基金、银华富裕主题混合型证券投资基金、银华领先策略混合型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选混合型证券投资基金(LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金(LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金(LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级混合型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选混合型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金(LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金(LOF)、银华永兴纯债债券型发起式证券投资基金(LOF)、银华交易型货币市场基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金、银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置

混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金、银华战略新兴灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华逆向投资灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华互联网主题灵活配置混合型证券投资基金、银华生态环保主题灵活配置混合型证券投资基金、银华合利债券型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、银华远景债券型证券投资基金、银华双动力债券型证券投资基金、银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金、银华多元视野灵活配置混合型证券投资基金、银华惠添益货币市场基金、银华鑫锐定增灵活配置混合型证券投资基金、银华通利灵活配置混合型证券投资基金、银华沪港深增长股票型证券投资基金、银华鑫盛定增灵活配置混合型证券投资基金、银华添泽定期开放债券型证券投资基金、银华体育文化灵活配置混合型证券投资基金、银华上证 5 年期国债指数证券投资基金、银华上证 10 年期国债指数证券投资基金、银华盛世精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、银华惠安定期开放混合型证券投资基金、银华添润定期开放债券型证券投资基金、银华惠丰定期开放混合型证券投资基金、银华中债-5 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华中债-10 年期国债期货期限匹配金融债指数证券投资基金、银华万物互联灵活配置混合型证券投资基金、银华中证 5 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中证 10 年期地方政府债指数证券投资基金、银华中债 AAA 信用债指数证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯先生	本基金的基金经理	2016 年 4 月 25 日	-	7 年	硕士学位。毕业于清华大学。2009 年 7 月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自 2012 年 11 月 14 日起担任银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金基金经理，自 2013 年 11 月 5 日起兼任银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基

					金经理，自 2016 年 1 月 14 日起兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，自 2016 年 4 月 7 日起兼任银华大数据灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。
--	--	--	--	--	---

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金使用量化策略进行资产配置和股票投资，并辅以固定收益投资和股指期货等衍生品进行收益增强。报告期内，本基金策略的绩效表现仍在我们的预期之内。我们将继续勤勉投资，力争获得超越基准指数的收益率。

2017 年二季度 A 股市场震荡上行，小幅上涨。 二季度沪深 300 指数上涨 6.10%，深证 100 指数小幅上涨 7.68%。二季度市场在窄幅震荡中小幅上行，从大小盘风格来看，大盘股票强于小盘股，深 100 指数涨幅好于沪深 300，行业方面，17 年以来表现最强的是以家电、食品饮料为主的消费和建材为首的周期行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.209 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.81%，业绩比较基准收益率为 3.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，十九大召开在即，开会年求稳是总基调，经济与政策在各自的上下轨间运动，保持现状是合理诉求，也是有客观条件支撑。本轮经济复苏由供给侧改革触发补库存开启，叠加全球库存周期共振，使得工业生产恢复，大宗商品价格大涨、全球贸易增速回暖。当前，库存周期进入到全球被动补库阶段，则下半年对应名义 GDP 回落，PPI 回落，全球贸易环比趋弱，此外将同时看到企业利润增速、财政收入增速回落。节奏上，三季度各项指标平缓回落，四季度的向下加速度将加大。从流动性来看，三季度监管对于机构去杠杆的监管和自查力度预计会减弱，有望在四季度终止。从行业配置来看，2015 年起消费对 GDP 贡献率超过固定资本形成，下半年全球库存周期回落中消费的稳定可能是经济的主要支撑力。由于监管方向变化带来的市场竞争格局变化，龙头股策略将是价值投资的主线，如周期消费成长的龙头股，如新零售龙头、油气等依然

值得配置；由于人口的变化，以轻奢品牌为代表的消费升级时代到来，消费升级主线的战略，如家电家具家居旅游休闲，苹果产业链、传媒、人工智能服务、基因治疗、教育等行业；自下而上选择增速与价格匹配的个股，白酒和医药龙头股；另外银行业估值依旧较低，另有高分红，依然是各大基金青睐的板块品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,103,134.46	7,998,209.66
结算备付金		666,092.52	923,717.43
存出保证金		85,674.35	32,608.53
交易性金融资产	6.4.7.2	67,381,559.79	84,840,079.02
其中：股票投资		67,381,559.79	84,840,079.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	25,000,000.00	-
应收证券清算款		21,575.34	35,829.37
应收利息	6.4.7.5	-1,962.64	3,742.72
应收股利		-	-
应收申购款		10,735.31	1,804.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		103,266,809.13	93,835,991.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,276,669.31
应付赎回款		66,474.02	5,381.17
应付管理人报酬		128,006.08	97,950.85
应付托管费		21,334.32	16,325.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	599,940.91	305,133.54

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	216,120.18	145,005.80
负债合计		1,031,875.51	3,846,465.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	84,591,942.87	72,320,067.59
未分配利润	6.4.7.10	17,642,990.75	17,669,457.67
所有者权益合计		102,234,933.62	89,989,525.26
负债和所有者权益总计		103,266,809.13	93,835,991.05

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.209 元，基金份额总额为 84,591,942.87 份。

6.2 利润表

会计主体：银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-3,843,624.58	-39,100.17
1.利息收入		75,601.67	31,786.00
其中：存款利息收入	6.4.7.11	55,429.07	6,322.53
债券利息收入		-	20,783.96
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,172.60	4,679.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,822,523.35	-44,636.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,249,496.49	-77,156.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	13,088.60
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	426,973.14	19,431.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,728,500.61	-27,066.86
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	174,796.49	817.02
减：二、费用		3,160,315.83	163,079.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	858,220.97	37,114.54
2. 托管费	6.4.10.2.2	143,036.84	6,185.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,963,557.55	55,208.59
5. 利息支出		-	90.82
其中：卖出回购金融资产支出		-	90.82
6. 其他费用	6.4.7.20	195,500.47	64,479.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,003,940.41	-202,179.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,003,940.41	-202,179.26

注：本基金基金合同于 2016 年 4 月 25 日起正式生效，本报告期上年度可比期间系 2016 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日止。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	72,320,067.59	17,669,457.67	89,989,525.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,003,940.41	-7,003,940.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	12,271,875.28	6,977,473.49	19,249,348.77
其中：1.基金申购款	92,840,743.65	20,758,183.95	113,598,927.60
2.基金赎回款	-80,568,868.37	-13,780,710.46	-94,349,578.83
四、本期向基金份额持	-	-	-

有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	84,591,942.87	17,642,990.75	102,234,933.62
项目	上年度可比期间 2016年4月25日(基金合同生效日)至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,007,264.31	2,956,206.26	13,963,470.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-202,179.26	-202,179.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-706,959.21	-185,836.45	-892,795.66
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-706,959.21	-185,836.45	-892,795.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	10,300,305.10	2,568,190.55	12,868,495.65

注：本基金基金合同于2016年4月25日起正式生效，本报告期上年度可比期间系2016年4月25日(基金合同生效日)至2016年6月30日止。

报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王立新

凌宇翔

龚飒

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）（原“银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]9 号《关于核准银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金募集的批复》的核准，由银华基金管理股份有限公司于 2013 年 4 月 10 日至 2013 年 5 月 17 日向社会公开募集，基金合同于 2013 年 5 月 22 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为 339,070,719.93 份基金份额。本基金管理人于 2016 年 3 月 28 日 15:00 起至 2016 年 4 月 15 日 17:00 止期间以通讯方式召开了银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金转型有关事项的议案》。本基金管理人于 2016 年 4 月 25 日发布了《关于银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据生效的基金份额持有人大会决议，自 2016 年 4 月 25 日起《银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金基金合同》失效且《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，同时基金更名为“银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金”。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为银华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准： $\text{中证 800 指数收益率} \times 50\% + \text{中国债券总指数收益率} \times 50\%$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	10,103,134.46
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	10,103,134.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	66,452,600.77	67,381,559.79	928,959.02
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	66,452,600.77	67,381,559.79	928,959.02
----	---------------	---------------	------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	25,000,000.00	-
合计	25,000,000.00	-

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	12,082.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	299.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-14,383.56
应收申购款利息	0.06
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	38.60
合计	-1,962.64

6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
----	-------------------

交易所市场应付交易费用	599,940.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	599,940.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	38.98
预提费用	216,081.20
合计	216,120.18

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,320,067.59	72,320,067.59
本期申购	92,840,743.65	92,840,743.65
本期赎回(以“-”号填列)	-80,568,868.37	-80,568,868.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	84,591,942.87	84,591,942.87

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,383,842.59	-17,714,384.92	17,669,457.67
本期利润	-10,732,441.02	3,728,500.61	-7,003,940.41
本期基金份额交易产生的变动数	6,209,241.70	768,231.79	6,977,473.49
其中：基金申购款	37,876,473.85	-17,118,289.90	20,758,183.95
基金赎回款	-31,667,232.15	17,886,521.69	-13,780,710.46
本期已分配利润	-	-	-

本期末	30,860,643.27	-13,217,652.52	17,642,990.75
-----	---------------	----------------	---------------

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	43,673.33
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	8,747.71
其他	3,008.03
合计	55,429.07

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	677,520,656.80
减：卖出股票成本总额	685,770,153.29
买卖股票差价收入	-8,249,496.49

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	426,973.14
基金投资产生的股利收益	-
合计	426,973.14

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,728,500.61
——股票投资	3,728,500.61
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	3,728,500.61

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	167,417.04
转换费	7,379.44
其他	0.01
合计	174,796.49

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,963,557.55
银行间市场交易费用	-
合计	1,963,557.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	148,765.71
银行费用	5,819.27
账户维护费	18,600.00
合计	195,500.47

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无需做披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
第一创业证券股份有限公司（“第一创业”）	基金管理人股东、基金代销机构
西南证券股份有限公司（“西南证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
东北证券股份有限公司（“东北证券”）	基金管理人股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年4月25日(基金合同生效日)至 2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东北证券	88,614,359.50	6.61%	-	-
西南证券	48,063,033.11	3.58%	-	-
第一创业	6,788,803.95	0.51%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
东北证券	82,527.28	7.07%	82,527.28	13.76%
西南证券	44,761.21	3.84%	-	-
第一创业	6,314.72	0.54%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年4月25日(基金合同生效日)至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
--	--	------	--	-------

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 6月30日	上年度可比期间 2016年4月25日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	858,220.97	37,114.54
其中：支付销售机构的客户维护费	36,397.35	15,902.15

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年4月25日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	143,036.84	6,185.74

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

均未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日均未运用固有资金投资本基金份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	10,103,134.46	43,673.33	1,105,655.06	6,047.84

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	699	6,731.37	6,731.37	-

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发流通受限的债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600734	实达集团	2017年4月5日	重大事项	12.75	-	-	98,700	1,374,419.72	1,258,425.00	-
600657	信达地产	2017年2月20日	重大事项	5.76	-	-	211,200	1,183,115.00	1,216,512.00	-
000100	TCL集团	2017年4月21日	重大事项	3.43	-	-	315,200	1,122,871.05	1,081,136.00	-
600239	云南城投	2017年6月26日	重大事项	5.22	-	-	25,900	134,512.00	135,198.00	-
600764	中电广通	2017年6月29日	重大事项	33.25	-	-	2,100	70,153.00	69,825.00	-

603126	中材 节能	2017 年 6 月 27 日	重 大 事 项	16.46	-	-	1,100	17,809.00	18,106.00	-
000693	ST 华泽	2016 年 3 月 1 日	重 大 事 项	12.50	-	-	332	8,363.53	4,150.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时根据设定的流动性比例要求，对流动性

指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.3.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	10,103,134.46	-	-	-	-	-	10,103,134.46
结算备付金	666,092.52	-	-	-	-	-	666,092.52
存出保证金	85,674.35	-	-	-	-	-	85,674.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	67,381,559.79	67,381,559.79
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	-	-	25,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	21,575.34	21,575.34
应收利息	-	-	-	-	-	-1,962.64	-1,962.64
应收申购款	-	-	-	-	-	10,735.31	10,735.31
资产总计	35,854,901.33	-	-	-	-	-67,411,907.80	103,266,809.13
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	66,474.02	66,474.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	128,006.08	128,006.08
应付托管费	-	-	-	-	-	21,334.32	21,334.32
应付交易费用	-	-	-	-	-	599,940.91	599,940.91
其他负债	-	-	-	-	-	216,120.18	216,120.18
负债总计	-	-	-	-	-	1,031,875.51	1,031,875.51
利率敏感度缺口	35,854,901.33	-	-	-	-	-66,380,032.29	102,234,933.62
上年度末 2016年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	7,998,209.66	-	-	-	-	-	7,998,209.66
结算备付金	923,717.43	-	-	-	-	-	923,717.43
存出保证金	32,608.53	-	-	-	-	-	32,608.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-84,840,079.02	84,840,079.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	35,829.37	35,829.37
应收利息	-	-	-	-	-	3,742.72	3,742.72
应收申购款	-	-	-	-	-	1,804.32	1,804.32
资产总计	8,954,535.62	-	-	-	-	-84,881,455.43	93,835,991.05
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-3,276,669.31	3,276,669.31
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,381.17	5,381.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	97,950.85	97,950.85
应付托管费	-	-	-	-	-	16,325.12	16,325.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	305,133.54	305,133.54
其他负债	-	-	-	-	-	145,005.80	145,005.80
负债总计	-	-	-	-	-	-3,846,465.79	3,846,465.79
利率敏感度缺口	8,954,535.62	-	-	-	-	-81,034,989.64	89,989,525.26

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.3.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金在报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.3.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债券、企业债券、公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换公司债券及分离交易可转债、可交换债券以及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）

。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%-95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于本报告期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.3.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	67,381,559.79	65.91	84,840,079.02	94.28
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	67,381,559.79	65.91	84,840,079.02	94.28

6.4.13.3.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变； 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险； Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了 基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	+5%	7,037,939.82	3,792,965.84
	-5%	-7,037,939.82	-3,792,965.84

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	67,381,559.79	65.25
	其中：股票	67,381,559.79	65.25
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	25,000,000.00	24.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	10,769,226.98	10.43
7	其他各项资产	116,022.36	0.11
8	合计	103,266,809.13	100.00

注：由于四舍五入的原因，市值占总资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	53,960.00	0.05
B	采矿业	2,189,956.00	2.14
C	制造业	24,103,700.87	23.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,274,199.00	2.22
E	建筑业	3,314,150.77	3.24
F	批发和零售业	1,992,494.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,178,303.68	2.13
H	住宿和餐饮业	117,272.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,682,088.85	1.65
J	金融业	23,619,465.76	23.10
K	房地产业	4,380,154.40	4.28
L	租赁和商务服务业	533,889.00	0.52

M	科学研究和技术服务业	18,106.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	44,536.46	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	46,713.00	0.05
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	715,456.00	0.70
S	综合	117,114.00	0.11
	合计	67,381,559.79	65.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	54,400	2,698,784.00	2.64
2	600036	招商银行	83,000	1,984,530.00	1.94
3	600519	贵州茅台	4,200	1,981,770.00	1.94
4	601166	兴业银行	116,600	1,965,876.00	1.92
5	601398	工商银行	351,500	1,845,375.00	1.81
6	600030	中信证券	82,200	1,399,044.00	1.37
7	600016	民生银行	164,000	1,348,080.00	1.32
8	600900	长江电力	86,400	1,328,832.00	1.30
9	600734	实达集团	98,700	1,258,425.00	1.23
10	600657	信达地产	211,200	1,216,512.00	1.19
11	601211	国泰君安	56,100	1,150,611.00	1.13
12	600000	浦发银行	90,300	1,142,295.00	1.12
13	600887	伊利股份	52,600	1,135,634.00	1.11
14	601328	交通银行	182,800	1,126,048.00	1.10
15	601668	中国建筑	114,300	1,106,424.00	1.08
16	601288	农业银行	311,300	1,095,776.00	1.07
17	000100	TCL 集团	315,200	1,081,136.00	1.06
18	600104	上汽集团	33,700	1,046,385.00	1.02
19	601601	中国太保	29,700	1,005,939.00	0.98
20	601766	中国中车	91,100	921,932.00	0.90

21	600837	海通证券	61,700	916,245.00	0.90
22	600276	恒瑞医药	17,200	870,148.00	0.85
23	600518	康美药业	37,100	806,554.00	0.79
24	600048	保利地产	73,200	729,804.00	0.71
25	601169	北京银行	78,400	718,928.00	0.70
26	601988	中国银行	181,800	672,660.00	0.66
27	600690	青岛海尔	43,900	660,695.00	0.65
28	600999	招商证券	35,900	618,198.00	0.60
29	600028	中国石化	103,000	610,790.00	0.60
30	601628	中国人寿	20,500	553,090.00	0.54
31	601688	华泰证券	29,900	535,210.00	0.52
32	601390	中国中铁	61,100	529,737.00	0.52
33	601985	中国核电	63,100	492,811.00	0.48
34	600085	同仁堂	13,900	485,944.00	0.48
35	600019	宝钢股份	71,300	478,423.00	0.47
36	601857	中国石油	61,800	475,242.00	0.46
37	600703	三安光电	23,800	468,860.00	0.46
38	600606	绿地控股	54,800	428,536.00	0.42
39	600196	复星医药	13,700	424,563.00	0.42
40	601186	中国铁建	33,700	405,411.00	0.40
41	600029	南方航空	45,200	393,240.00	0.38
42	600741	华域汽车	16,100	390,264.00	0.38
43	600585	海螺水泥	17,000	386,410.00	0.38
44	601607	上海医药	13,300	384,104.00	0.38
45	600660	福耀玻璃	14,400	374,976.00	0.37
46	601336	新华保险	7,200	370,080.00	0.36
47	600309	万华化学	12,400	355,136.00	0.35
48	600031	三一重工	41,200	334,956.00	0.33
49	600066	宇通客车	14,600	320,762.00	0.31
50	601006	大秦铁路	38,200	320,498.00	0.31
51	601669	中国电建	39,800	315,216.00	0.31
52	600340	华夏幸福	9,000	302,220.00	0.30
53	600637	东方明珠	13,600	294,712.00	0.29
54	601888	中国国旅	9,600	289,344.00	0.28
55	600010	包钢股份	129,500	283,605.00	0.28
56	601225	陕西煤业	39,500	279,265.00	0.27
57	600271	航天信息	13,100	270,384.00	0.26
58	600089	特变电工	25,600	264,448.00	0.26
59	600663	陆家嘴	11,100	262,404.00	0.26

60	601009	南京银行	23,400	262,314.00	0.26
61	600535	天士力	6,300	261,702.00	0.26
62	600015	华夏银行	27,960	257,791.20	0.25
63	601899	紫金矿业	75,100	257,593.00	0.25
64	600436	片仔癀	4,200	256,368.00	0.25
65	601229	上海银行	10,000	255,400.00	0.25
66	601018	宁波港	44,800	253,120.00	0.25
67	601933	永辉超市	34,400	243,552.00	0.24
68	600068	葛洲坝	21,400	240,536.00	0.24
69	600009	上海机场	6,400	238,784.00	0.23
70	601800	中国交建	15,000	238,350.00	0.23
71	600118	中国卫星	8,400	233,856.00	0.23
72	600406	国电南瑞	13,200	232,980.00	0.23
73	600522	中天科技	18,900	227,745.00	0.22
74	601111	中国国航	23,300	227,175.00	0.22
75	600816	安信信托	16,400	222,876.00	0.22
76	600332	白云山	7,400	214,896.00	0.21
77	600018	上港集团	33,600	213,024.00	0.21
78	600177	雅戈尔	20,400	206,448.00	0.20
79	600498	烽火通信	8,100	205,335.00	0.20
80	601600	中国铝业	45,300	204,756.00	0.20
81	601155	新城控股	11,000	203,940.00	0.20
82	600886	国投电力	25,600	202,240.00	0.20
83	600297	广汇汽车	26,300	198,039.00	0.19
84	600588	用友网络	11,500	196,880.00	0.19
85	600682	南京新百	5,300	195,570.00	0.19
86	600373	中文传媒	8,200	192,782.00	0.19
87	600383	金地集团	16,400	188,108.00	0.18
88	601633	长城汽车	13,900	184,731.00	0.18
89	603993	洛阳钼业	35,800	181,148.00	0.18
90	600115	东方航空	24,700	167,960.00	0.16
91	600109	国金证券	14,000	164,080.00	0.16
92	601818	光大银行	40,100	162,405.00	0.16
93	601877	正泰电器	8,000	160,720.00	0.16
94	600688	上海石化	24,000	158,640.00	0.16
95	600739	辽宁成大	8,700	156,861.00	0.15
96	601618	中国中冶	30,400	152,304.00	0.15
97	600415	小商品城	20,800	150,592.00	0.15
98	601992	金隅股份	23,100	149,457.00	0.15

99	600060	海信电器	9,700	147,149.00	0.14
100	601098	中南传媒	7,800	145,392.00	0.14
101	600715	文投控股	6,400	144,384.00	0.14
102	601216	君正集团	28,800	140,832.00	0.14
103	603160	汇顶科技	1,400	140,420.00	0.14
104	600111	北方稀土	12,200	138,226.00	0.14
105	600239	云南城投	25,900	135,198.00	0.13
106	600804	鹏博士	7,600	134,900.00	0.13
107	600547	山东黄金	4,600	133,078.00	0.13
108	601998	中信银行	21,100	132,719.00	0.13
109	601012	隆基股份	7,700	131,670.00	0.13
110	600718	东软集团	8,400	130,620.00	0.13
111	601099	太平洋	32,200	129,444.00	0.13
112	603816	顾家家居	2,200	129,316.00	0.13
113	600487	亨通光电	4,500	126,225.00	0.12
114	600977	中国电影	6,600	123,552.00	0.12
115	603355	莱克电气	2,100	123,417.00	0.12
116	600372	中航电子	7,000	121,590.00	0.12
117	601878	浙商证券	7,013	119,291.13	0.12
118	601198	东兴证券	6,800	117,232.00	0.11
119	601718	际华集团	13,300	116,907.00	0.11
120	600208	新潮中宝	25,800	116,100.00	0.11
121	603288	海天味业	2,800	114,184.00	0.11
122	600867	通化东宝	6,200	113,088.00	0.11
123	600839	四川长虹	31,200	112,944.00	0.11
124	600176	中国巨石	10,200	111,996.00	0.11
125	600895	张江高科	6,600	111,408.00	0.11
126	600008	首创股份	16,900	111,202.00	0.11
127	600704	物产中大	15,000	109,350.00	0.11
128	600566	济川药业	2,800	106,484.00	0.10
129	600516	方大炭素	7,200	102,384.00	0.10
130	600978	宜华生活	10,100	101,505.00	0.10
131	600233	圆通速递	5,000	97,950.00	0.10
132	603898	好莱客	2,800	97,860.00	0.10
133	600038	中直股份	2,100	96,117.00	0.09
134	600827	百联股份	5,800	94,250.00	0.09
135	600161	天坛生物	2,400	93,144.00	0.09
136	603858	步长制药	1,300	93,132.00	0.09
137	600919	江苏银行	9,991	92,816.39	0.09

138	600337	美克家居	16,300	92,095.00	0.09
139	600150	中国船舶	3,900	89,193.00	0.09
140	600649	城投控股	8,400	88,284.00	0.09
141	600446	金证股份	5,000	87,900.00	0.09
142	600885	宏发股份	2,200	87,758.00	0.09
143	603868	飞科电器	1,400	86,576.00	0.08
144	603258	电魂网络	2,100	86,184.00	0.08
145	600061	国投安信	5,500	85,525.00	0.08
146	600600	青岛啤酒	2,400	84,240.00	0.08
147	600153	建发股份	6,400	82,752.00	0.08
148	603883	老百姓	1,700	82,705.00	0.08
149	600562	国睿科技	3,000	82,620.00	0.08
150	600958	东方证券	5,900	82,069.00	0.08
151	600201	生物股份	2,300	81,811.00	0.08
152	603589	口子窖	2,100	81,459.00	0.08
153	600489	中金黄金	8,100	81,243.00	0.08
154	601238	广汽集团	3,000	78,180.00	0.08
155	601689	拓普集团	2,300	77,027.00	0.08
156	601231	环旭电子	4,700	73,837.00	0.07
157	600699	均胜电子	2,300	73,807.00	0.07
158	600138	中青旅	3,500	73,710.00	0.07
159	601881	中国银河	6,213	73,686.18	0.07
160	600809	山西汾酒	2,100	72,849.00	0.07
161	603515	欧普照明	2,000	72,240.00	0.07
162	603008	喜临门	4,000	71,240.00	0.07
163	600482	中国动力	2,800	70,812.00	0.07
164	600705	中航资本	12,500	70,625.00	0.07
165	603556	海兴电力	1,600	70,224.00	0.07
166	600764	中电广通	2,100	69,825.00	0.07
167	601997	贵阳银行	4,400	69,564.00	0.07
168	600612	老凤祥	1,400	68,558.00	0.07
169	600990	四创电子	1,100	68,189.00	0.07
170	601117	中国化学	9,600	67,104.00	0.07
171	603678	火炬电子	2,400	66,792.00	0.07
172	600909	华安证券	6,530	65,887.70	0.06
173	603000	人民网	5,000	65,850.00	0.06
174	600270	外运发展	3,400	64,362.00	0.06
175	600563	法拉电子	1,300	64,233.00	0.06
176	603936	博敏电子	2,400	63,240.00	0.06

177	600258	首旅酒店	2,700	63,072.00	0.06
178	600426	华鲁恒升	5,300	62,222.00	0.06
179	600338	西藏珠峰	1,600	60,784.00	0.06
180	601375	中原证券	5,936	59,716.16	0.06
181	600362	江西铜业	3,500	59,010.00	0.06
182	600366	宁波韵升	3,300	58,212.00	0.06
182	600848	上海临港	2,700	58,212.00	0.06
183	600376	首开股份	4,900	56,056.00	0.05
184	603658	安图生物	1,300	56,030.00	0.05
185	600053	九鼎投资	1,600	55,936.00	0.05
186	600820	隧道股份	5,500	55,550.00	0.05
187	603833	欧派家居	500	54,930.00	0.05
188	600754	锦江股份	2,000	54,200.00	0.05
189	600398	海澜之家	5,700	54,093.00	0.05
190	601118	海南橡胶	9,500	53,960.00	0.05
191	603939	益丰药房	1,600	53,920.00	0.05
192	603818	曲美家居	3,300	52,569.00	0.05
193	600685	中船防务	1,900	52,022.00	0.05
194	600756	浪潮软件	2,600	51,454.00	0.05
195	603996	中新科技	3,000	51,300.00	0.05
196	603019	中科曙光	1,800	50,652.00	0.05
197	600250	南纺股份	3,500	50,575.00	0.05
198	603337	杰克股份	1,300	50,310.00	0.05
199	600983	惠而浦	4,600	49,772.00	0.05
200	600037	歌华有线	3,400	49,504.00	0.05
201	600884	杉杉股份	3,000	49,410.00	0.05
202	600298	安琪酵母	1,900	49,153.00	0.05
203	600571	信雅达	3,500	48,650.00	0.05
204	600633	浙数文化	2,500	48,300.00	0.05
205	603328	依顿电子	3,400	48,110.00	0.05
206	600352	浙江龙盛	5,000	47,650.00	0.05
207	600511	国药股份	1,300	47,112.00	0.05
208	603989	艾华集团	1,200	47,088.00	0.05
209	600188	兖州煤业	3,800	46,512.00	0.05
210	603338	浙江鼎力	700	46,151.00	0.05
211	601966	玲珑轮胎	2,000	44,860.00	0.04
212	603778	乾景园林	3,700	44,548.00	0.04
213	600183	生益科技	3,600	44,424.00	0.04
214	600584	长电科技	2,700	43,335.00	0.04

215	600850	华东电脑	2,000	42,740.00	0.04
216	603799	华友钴业	700	42,546.00	0.04
217	600779	水井坊	1,700	41,786.00	0.04
218	600062	华润双鹤	1,500	41,145.00	0.04
219	601333	广深铁路	8,900	40,228.00	0.04
220	600107	美尔雅	2,900	40,194.00	0.04
221	600771	广誉远	1,000	39,950.00	0.04
222	600158	中体产业	2,300	39,330.00	0.04
223	600674	川投能源	4,000	39,280.00	0.04
224	600435	北方导航	2,700	38,637.00	0.04
225	603899	晨光文具	2,200	38,280.00	0.04
226	600240	华业资本	4,100	37,146.00	0.04
227	603885	吉祥航空	2,400	36,432.00	0.04
228	600879	航天电子	4,100	36,039.00	0.04
229	603528	多伦科技	2,500	35,925.00	0.04
230	600967	内蒙一机	2,600	35,438.00	0.03
231	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.03
232	600185	格力地产	5,100	34,629.00	0.03
233	600167	联美控股	1,600	33,984.00	0.03
234	603377	东方时尚	900	33,831.00	0.03
235	601021	春秋航空	1,000	33,630.00	0.03
236	600260	凯乐科技	1,300	32,942.00	0.03
237	600528	中铁工业	2,300	32,867.00	0.03
238	600346	恒力股份	4,000	32,800.00	0.03
239	600132	重庆啤酒	1,400	32,634.00	0.03
240	600280	中央商场	4,100	32,513.00	0.03
241	600315	上海家化	1,000	32,450.00	0.03
242	600477	杭萧钢构	2,100	32,046.00	0.03
243	600410	华胜天成	3,600	31,896.00	0.03
244	600684	珠江实业	3,600	31,680.00	0.03
245	603043	广州酒家	1,230	31,082.10	0.03
246	600110	诺德股份	2,200	30,998.00	0.03
247	600023	浙能电力	5,600	30,576.00	0.03
248	603801	志邦股份	890	30,082.00	0.03
249	600325	华发股份	3,600	30,060.00	0.03
250	601127	小康股份	1,500	29,925.00	0.03
251	600486	扬农化工	700	29,547.00	0.03
252	600130	波导股份	4,900	29,057.00	0.03
253	603369	今世缘	2,200	29,040.00	0.03

254	600507	方大特钢	3,400	29,002.00	0.03
255	600871	石化油服	8,500	28,390.00	0.03
256	603444	吉比特	100	28,333.00	0.03
257	600926	杭州银行	1,900	28,215.00	0.03
258	600549	厦门钨业	1,300	27,937.00	0.03
259	600071	凤凰光学	1,200	27,204.00	0.03
260	601116	三江购物	1,000	26,820.00	0.03
261	600675	中华企业	3,800	25,878.00	0.03
262	603313	梦百合	800	25,664.00	0.03
263	600845	宝信软件	1,500	25,275.00	0.02
264	600521	华海药业	1,200	25,248.00	0.02
265	600652	游久游戏	2,300	25,116.00	0.02
266	600209	罗顿发展	1,800	25,092.00	0.02
267	601611	中国核建	2,041	24,430.77	0.02
268	601928	凤凰传媒	2,500	24,400.00	0.02
269	600390	五矿资本	2,000	24,220.00	0.02
270	600226	瀚叶股份	2,700	23,841.00	0.02
271	600622	嘉宝集团	1,430	23,280.40	0.02
272	600293	三峡新材	2,100	22,512.00	0.02
273	600667	太极实业	3,200	22,304.00	0.02
274	600004	白云机场	1,200	22,152.00	0.02
275	603568	伟明环保	1,000	21,620.00	0.02
276	600998	九州通	1,000	21,560.00	0.02
277	600090	同济堂	2,300	21,551.00	0.02
278	603679	华体科技	809	21,438.50	0.02
279	600707	彩虹股份	2,700	21,384.00	0.02
280	600870	厦华电子	2,700	21,330.00	0.02
281	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.02
282	600728	佳都科技	2,700	20,898.00	0.02
283	600056	中国医药	800	20,760.00	0.02
284	600086	东方金钰	1,900	20,539.00	0.02
285	603660	苏州科达	500	20,475.00	0.02
285	603696	安记食品	500	20,475.00	0.02
286	603958	哈森股份	800	20,416.00	0.02
287	600872	中炬高新	1,100	20,130.00	0.02
288	603165	荣晟环保	300	19,905.00	0.02
289	600478	科力远	2,300	19,803.00	0.02
290	603085	天成自控	800	19,704.00	0.02
291	603626	科森科技	300	19,554.00	0.02

292	603169	兰石重装	1,600	19,440.00	0.02
293	600162	香江控股	5,400	19,386.00	0.02
294	600550	保变电气	1,800	19,368.00	0.02
295	601801	皖新传媒	1,400	19,348.00	0.02
296	600179	安通控股	1,100	19,239.00	0.02
297	600546	山煤国际	4,000	19,160.00	0.02
298	600525	长园集团	1,400	19,026.00	0.02
299	603388	元成股份	500	18,785.00	0.02
300	600007	中国国贸	900	18,729.00	0.02
301	603777	来伊份	500	18,565.00	0.02
302	600021	上海电力	1,500	18,135.00	0.02
303	603126	中材节能	1,100	18,106.00	0.02
304	600898	国美通讯	1,200	17,676.00	0.02
305	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.02
306	603368	柳州医药	300	17,175.00	0.02
307	600781	辅仁药业	800	17,032.00	0.02
308	600640	号百控股	1,000	16,900.00	0.02
309	603421	鼎信通讯	600	16,794.00	0.02
310	603888	新华网	500	16,195.00	0.02
311	600409	三友化工	1,600	16,112.00	0.02
312	600693	东百集团	1,300	16,016.00	0.02
313	603806	福斯特	500	16,005.00	0.02
314	600114	东睦股份	900	15,750.00	0.02
315	601567	三星医疗	1,500	15,630.00	0.02
316	603896	寿仙谷	400	15,604.00	0.02
317	603986	兆易创新	200	15,562.00	0.02
318	600388	龙净环保	1,000	15,530.00	0.02
319	600876	洛阳玻璃	800	15,232.00	0.01
320	600184	光电股份	800	15,008.00	0.01
321	600393	粤泰股份	2,000	14,480.00	0.01
322	600151	航天机电	1,700	13,991.00	0.01
323	600803	新奥股份	1,000	13,740.00	0.01
324	600874	创业环保	700	13,699.00	0.01
325	600698	湖南天雁	1,400	13,566.00	0.01
326	603919	金徽酒	700	13,356.00	0.01
327	603180	金牌厨柜	200	13,220.00	0.01
328	601101	昊华能源	1,600	13,120.00	0.01
329	600880	博瑞传播	2,000	13,060.00	0.01
330	603579	荣泰健康	100	12,982.00	0.01

331	600466	蓝光发展	1,500	12,945.00	0.01
332	600661	新南洋	600	12,882.00	0.01
333	600336	澳柯玛	2,200	12,782.00	0.01
334	603703	盛洋科技	700	12,579.00	0.01
335	600793	宜宾纸业	300	12,435.00	0.01
336	600986	科达股份	900	12,204.00	0.01
337	601788	光大证券	800	11,944.00	0.01
338	600230	沧州大化	400	11,888.00	0.01
339	603007	花王股份	600	11,724.00	0.01
340	600242	中昌数据	700	11,711.00	0.01
341	603138	海量数据	260	11,564.80	0.01
342	601880	大连港	3,900	11,544.00	0.01
343	600170	上海建工	3,000	11,460.00	0.01
344	603189	网达软件	500	10,740.00	0.01
345	603385	惠达卫浴	400	10,716.00	0.01
346	600702	沱牌舍得	400	10,644.00	0.01
347	600288	大恒科技	1,000	10,600.00	0.01
348	601163	三角轮胎	400	10,520.00	0.01
349	603505	金石资源	500	10,305.00	0.01
350	600321	国栋建设	2,300	10,212.00	0.01
351	600791	京能置业	1,100	10,131.00	0.01
352	600557	康缘药业	600	9,966.00	0.01
353	603881	数据港	200	9,764.00	0.01
354	603228	景旺电子	200	9,650.00	0.01
355	603322	超讯通信	200	9,640.00	0.01
356	600536	中国软件	500	9,580.00	0.01
357	603306	华懋科技	300	9,492.00	0.01
358	600828	茂业商业	1,100	9,152.00	0.01
359	603578	三星新材	200	9,134.00	0.01
360	600687	刚泰控股	700	9,016.00	0.01
361	603920	世运电路	400	8,968.00	0.01
362	603555	贵人鸟	400	8,944.00	0.01
363	600246	万通地产	1,800	8,910.00	0.01
364	600773	西藏城投	800	8,856.00	0.01
365	603186	华正新材	200	8,554.00	0.01
366	600480	凌云股份	400	8,436.00	0.01
367	603005	晶方科技	300	8,397.00	0.01
368	603603	博天环境	200	8,396.00	0.01
369	603838	四通股份	600	8,262.00	0.01

370	600821	津劝业	900	8,109.00	0.01
371	601200	上海环境	300	8,007.00	0.01
372	603078	江化微	100	7,974.00	0.01
373	601228	广州港	914	7,878.68	0.01
374	600135	乐凯胶片	500	7,795.00	0.01
375	600133	东湖高新	800	7,672.00	0.01
376	600594	益佰制药	500	7,630.00	0.01
377	600148	长春一东	300	7,515.00	0.01
378	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.01
379	603225	新凤鸣	200	7,236.00	0.01
380	600892	大晟文化	600	7,188.00	0.01
381	603638	艾迪精密	200	7,136.00	0.01
382	603098	森特股份	300	6,924.00	0.01
383	600182	S 佳通	300	6,897.00	0.01
384	603586	金麒麟	200	6,810.00	0.01
385	603331	百达精工	699	6,731.37	0.01
386	603717	天域生态	200	6,522.00	0.01
387	603737	三棵树	100	6,413.00	0.01
388	600476	湘邮科技	300	6,411.00	0.01
389	603039	泛微网络	100	6,355.00	0.01
390	600855	航天长峰	300	6,354.00	0.01
391	600797	浙大网新	500	6,195.00	0.01
392	600355	精伦电子	700	6,118.00	0.01
393	600841	上柴股份	400	6,104.00	0.01
394	600070	浙江富润	500	5,940.00	0.01
395	603615	茶花股份	300	5,937.00	0.01
396	600604	市北高新	800	5,720.00	0.01
397	600082	海泰发展	900	5,706.00	0.01
398	603066	音飞储存	400	5,688.00	0.01
399	600996	贵广网络	465	5,566.05	0.01
400	600416	湘电股份	400	5,480.00	0.01
401	601212	白银有色	646	5,258.44	0.01
402	600419	天润乳业	100	5,013.00	0.00
403	600679	上海凤凰	200	4,942.00	0.00
404	600529	山东药玻	200	4,914.00	0.00
405	603038	华立股份	100	4,800.00	0.00
406	603903	中持股份	100	4,779.00	0.00
407	603616	韩建河山	200	4,774.00	0.00
408	600533	栖霞建设	800	4,704.00	0.00

409	600647	同达创业	200	4,620.00	0.00
410	600069	银鸽投资	500	4,565.00	0.00
411	603032	德新交运	100	4,490.00	0.00
412	603955	大千生态	100	4,468.00	0.00
413	600155	宝硕股份	300	4,434.00	0.00
414	601020	华钰矿业	200	4,406.00	0.00
415	603179	新泉股份	100	4,391.00	0.00
416	601890	亚星锚链	500	4,345.00	0.00
417	600491	龙元建设	400	4,292.00	0.00
418	603319	湘油泵	100	4,275.00	0.00
419	601500	通用股份	300	4,266.00	0.00
420	603096	新经典	100	4,238.00	0.00
421	601000	唐山港	800	4,176.00	0.00
422	000693	ST 华泽	332	4,150.00	0.00
423	600581	八一钢铁	400	4,028.00	0.00
424	603991	至正股份	100	4,024.00	0.00
425	600497	驰宏锌锗	600	3,930.00	0.00
426	603037	凯众股份	100	3,785.00	0.00
427	600381	青海春天	300	3,774.00	0.00
428	600317	营口港	1,100	3,773.00	0.00
429	600639	浦东金桥	200	3,624.00	0.00
430	600335	国机汽车	300	3,588.00	0.00
431	603320	迪贝电气	100	3,556.00	0.00
432	603558	健盛集团	200	3,504.00	0.00
433	603517	绝味食品	100	3,487.00	0.00
434	603686	龙马环卫	100	3,440.00	0.00
434	603817	海峡环保	200	3,440.00	0.00
435	603133	碳元科技	100	3,356.00	0.00
436	603569	长久物流	100	3,343.00	0.00
437	600722	金牛化工	300	3,108.00	0.00
438	603030	全筑股份	300	3,087.00	0.00
439	600266	北京城建	200	2,908.00	0.00
440	601366	利群股份	200	2,780.00	0.00
441	600853	龙建股份	400	2,468.00	0.00
442	600599	熊猫金控	100	2,462.00	0.00
443	600285	羚锐制药	200	2,246.00	0.00
444	600291	西水股份	100	2,200.00	0.00
445	603058	永吉股份	100	2,170.00	0.00
446	603389	亚振家居	100	1,763.00	0.00

447	600970	中材国际	200	1,738.00	0.00
448	603177	德创环保	91	1,734.46	0.00
449	600800	天津磁卡	200	1,542.00	0.00
450	600717	天津港	100	1,249.00	0.00
451	600300	维维股份	200	1,068.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	5,651,221.00	6.28
2	601318	中国平安	4,947,303.79	5.50
3	600073	上海梅林	4,654,593.55	5.17
4	601186	中国铁建	4,315,921.00	4.80
5	600048	保利地产	4,242,544.59	4.71
6	600170	上海建工	4,091,629.00	4.55
7	600410	华胜天成	3,909,276.32	4.34
8	300336	新文化	3,854,161.46	4.28
9	600166	福田汽车	3,814,421.00	4.24
10	601288	农业银行	3,790,125.00	4.21
11	600060	海信电器	3,706,969.16	4.12
12	600500	中化国际	3,616,912.00	4.02
13	601006	大秦铁路	3,488,055.33	3.88
14	600623	华谊集团	3,471,655.45	3.86
15	600183	生益科技	3,362,484.00	3.74
16	600216	浙江医药	3,328,991.50	3.70
17	600039	四川路桥	3,308,525.56	3.68
18	601233	桐昆股份	3,296,164.47	3.66
19	600320	振华重工	3,231,358.36	3.59
20	600995	文山电力	3,214,928.90	3.57
21	600677	航天通信	3,204,406.00	3.56
22	600233	圆通速递	3,187,854.93	3.54
23	600519	贵州茅台	3,149,330.47	3.50

24	000012	南 玻 A	3,132,021.00	3.48
25	601390	中国中铁	3,042,998.00	3.38
26	600129	太极集团	3,015,101.44	3.35
27	601877	正泰电器	3,011,716.27	3.35
28	601398	工商银行	2,996,150.00	3.33
29	600674	川投能源	2,965,651.00	3.30
30	600020	中原高速	2,940,995.00	3.27
31	600839	四川长虹	2,860,726.00	3.18
32	600350	山东高速	2,823,817.92	3.14
33	600383	金地集团	2,806,261.75	3.12
34	601766	中国中车	2,764,821.28	3.07
35	002736	国信证券	2,748,840.79	3.05
36	600582	天地科技	2,709,336.00	3.01
37	600291	西水股份	2,702,167.80	3.00
38	002386	天原集团	2,690,248.68	2.99
39	000001	平安银行	2,669,951.07	2.97
40	002071	长城影视	2,627,054.70	2.92
41	600606	绿地控股	2,614,001.00	2.90
42	600418	江淮汽车	2,597,649.95	2.89
43	000733	振华科技	2,543,833.00	2.83
44	600823	世茂股份	2,531,866.00	2.81
45	300273	和佳股份	2,528,530.01	2.81
46	600362	江西铜业	2,526,737.00	2.81
47	002604	龙力生物	2,502,754.06	2.78
48	600580	卧龙电气	2,500,459.51	2.78
49	600036	招商银行	2,490,891.00	2.77
50	600176	中国巨石	2,488,629.20	2.77
51	601898	中煤能源	2,469,376.00	2.74
52	000966	长源电力	2,380,375.67	2.65
53	300242	明家联合	2,358,481.45	2.62
54	600141	兴发集团	2,356,260.32	2.62
55	000667	美好集团	2,347,026.95	2.61
56	000732	泰禾集团	2,339,116.96	2.60
57	601788	光大证券	2,330,568.00	2.59
58	601179	中国西电	2,302,718.00	2.56
59	000550	江铃汽车	2,282,973.00	2.54

60	600751	天海投资	2,273,634.78	2.53
61	600189	吉林森工	2,249,227.00	2.50
62	002067	景兴纸业	2,234,011.00	2.48
63	000786	北新建材	2,231,005.46	2.48
64	600115	东方航空	2,226,868.00	2.47
65	600563	法拉电子	2,224,345.40	2.47
66	601328	交通银行	2,222,340.00	2.47
67	601988	中国银行	2,220,433.00	2.47
68	601038	一拖股份	2,219,373.00	2.47
69	600026	中远海能	2,211,293.00	2.46
70	601166	兴业银行	2,186,513.00	2.43
71	300562	乐心医疗	2,179,052.37	2.42
72	300431	暴风集团	2,175,580.00	2.42
73	002309	中利集团	2,165,879.79	2.41
74	600647	同达创业	2,165,618.00	2.41
75	000729	燕京啤酒	2,144,022.57	2.38
76	600057	象屿股份	2,124,482.01	2.36
77	601669	中国电建	2,124,364.19	2.36
78	600064	南京高科	2,120,834.00	2.36
79	300533	冰川网络	2,117,262.00	2.35
80	601699	潞安环能	2,116,958.72	2.35
81	600000	浦发银行	2,106,624.00	2.34
82	601020	华钰矿业	2,103,010.69	2.34
83	002707	众信旅游	2,093,356.91	2.33
84	600502	安徽水利	2,092,980.91	2.33
85	002416	爱施德	2,086,660.94	2.32
86	600819	耀皮玻璃	2,086,215.30	2.32
87	002234	民和股份	2,082,223.16	2.31
88	600782	新钢股份	2,080,696.00	2.31
89	000718	苏宁环球	2,080,506.00	2.31
90	300474	景嘉微	2,071,103.82	2.30
91	601336	新华保险	2,070,881.62	2.30
92	600660	福耀玻璃	2,066,410.00	2.30
93	603026	石大胜华	2,063,009.00	2.29
94	600433	冠豪高新	2,030,421.63	2.26
95	300359	全通教育	2,020,943.00	2.25

96	601636	旗滨集团	1,999,193.00	2.22
97	600757	长江传媒	1,992,889.00	2.21
98	600016	民生银行	1,986,033.00	2.21
99	000488	晨鸣纸业	1,980,967.89	2.20
100	600997	开滦股份	1,980,705.00	2.20
101	000543	皖能电力	1,976,869.89	2.20
102	600130	波导股份	1,975,866.00	2.20
103	600177	雅戈尔	1,966,098.05	2.18
104	603128	华贸物流	1,964,994.00	2.18
105	002325	洪涛股份	1,959,421.59	2.18
106	600300	维维股份	1,956,541.00	2.17
107	300234	开尔新材	1,956,510.01	2.17
108	600704	物产中大	1,955,385.00	2.17
109	300146	汤臣倍健	1,949,086.50	2.17
110	600739	辽宁成大	1,945,756.00	2.16
111	300047	天源迪科	1,935,003.00	2.15
112	600892	大晟文化	1,929,704.00	2.14
113	600517	置信电气	1,927,431.00	2.14
114	000571	新大洲A	1,926,650.90	2.14
115	000848	承德露露	1,926,410.00	2.14
116	600984	建设机械	1,914,971.83	2.13
117	600028	中国石化	1,908,203.00	2.12
118	603800	道森股份	1,901,331.00	2.11
119	600642	申能股份	1,894,936.65	2.11
120	000536	华映科技	1,882,277.54	2.09
121	600285	羚锐制药	1,878,368.80	2.09
122	600067	冠城大通	1,867,808.92	2.08
123	600801	华新水泥	1,867,246.00	2.07
124	600761	安徽合力	1,866,979.42	2.07
125	603322	超讯通信	1,860,573.00	2.07
126	000951	中国重汽	1,848,938.06	2.05
127	002344	海宁皮城	1,848,355.00	2.05
128	600811	东方集团	1,846,147.00	2.05
129	601789	宁波建工	1,838,443.00	2.04
130	600338	西藏珠峰	1,838,178.00	2.04
131	600856	中天能源	1,828,660.00	2.03

132	000623	吉林敖东	1,824,206.00	2.03
133	600537	亿晶光电	1,820,201.46	2.02
134	600409	三友化工	1,819,639.66	2.02
135	002157	正邦科技	1,812,849.48	2.01
136	000915	山大华特	1,809,784.81	2.01
137	600649	城投控股	1,809,556.48	2.01
138	600395	盘江股份	1,807,042.00	2.01
139	002458	益生股份	1,805,522.00	2.01
140	600106	重庆路桥	1,805,368.00	2.01
141	002556	辉隆股份	1,801,089.84	2.00

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600170	上海建工	5,530,092.46	6.15
2	601668	中国建筑	4,742,848.00	5.27
3	600073	上海梅林	4,691,655.56	5.21
4	600623	华谊集团	4,586,442.31	5.10
5	600216	浙江医药	4,397,178.34	4.89
6	600350	山东高速	4,168,742.38	4.63
7	600129	太极集团	4,114,766.14	4.57
8	600410	华胜天成	3,926,121.97	4.36
9	601390	中国中铁	3,910,499.54	4.35
10	601898	中煤能源	3,862,592.00	4.29
11	601186	中国铁建	3,810,302.00	4.23
12	300336	新文化	3,738,166.61	4.15
13	600166	福田汽车	3,701,408.00	4.11
14	600500	中化国际	3,682,730.00	4.09
15	600418	江淮汽车	3,576,918.23	3.97
16	600060	海信电器	3,554,338.10	3.95
17	600048	保利地产	3,481,240.00	3.87
18	600320	振华重工	3,416,723.50	3.80
19	601233	桐昆股份	3,312,204.87	3.68
20	600233	圆通速递	3,240,127.98	3.60

21	600183	生益科技	3,213,618.31	3.57
22	600642	申能股份	3,208,326.20	3.57
23	600811	东方集团	3,195,472.00	3.55
24	601006	大秦铁路	3,184,531.00	3.54
25	600995	文山电力	3,183,394.22	3.54
26	600335	国机汽车	3,181,813.70	3.54
27	600757	长江传媒	3,143,068.14	3.49
28	600270	外运发展	3,116,931.00	3.46
29	000001	平安银行	3,051,441.35	3.39
30	600835	上海机电	3,033,378.01	3.37
31	600677	航天通信	3,023,581.82	3.36
32	600177	雅戈尔	3,007,748.66	3.34
33	600020	中原高速	3,000,584.00	3.33
34	600674	川投能源	2,957,361.00	3.29
35	600580	卧龙电气	2,928,053.89	3.25
36	600039	四川路桥	2,913,249.70	3.24
37	601877	正泰电器	2,886,969.10	3.21
38	000012	南玻A	2,885,910.18	3.21
39	600823	世茂股份	2,828,169.40	3.14
40	600100	同方股份	2,813,714.10	3.13
41	600582	天地科技	2,784,657.08	3.09
42	000667	美好集团	2,727,367.77	3.03
43	600694	大商股份	2,708,026.40	3.01
44	600741	华域汽车	2,702,441.57	3.00
45	601288	农业银行	2,684,321.00	2.98
46	600755	厦门国贸	2,684,281.39	2.98
47	002736	国信证券	2,681,114.50	2.98
48	600076	康欣新材	2,668,346.00	2.97
49	600383	金地集团	2,639,500.73	2.93
50	000729	燕京啤酒	2,637,702.00	2.93
51	000733	振华科技	2,586,299.36	2.87
52	300273	和佳股份	2,576,117.15	2.86
53	000966	长源电力	2,559,323.00	2.84
54	002386	天原集团	2,537,596.00	2.82
55	600537	亿晶光电	2,523,871.00	2.80
56	600366	宁波韵升	2,514,749.86	2.79
57	600188	兖州煤业	2,512,444.00	2.79
58	002604	龙力生物	2,510,639.93	2.79

59	600141	兴发集团	2,503,978.00	2.78
60	300242	明家联合	2,486,973.42	2.76
61	000540	中天金融	2,484,391.00	2.76
62	600291	西水股份	2,478,347.12	2.75
63	002234	民和股份	2,474,721.50	2.75
64	002309	中利集团	2,465,752.00	2.74
65	002071	长城影视	2,465,631.55	2.74
66	300562	乐心医疗	2,435,010.80	2.71
67	600176	中国巨石	2,409,976.00	2.68
68	600839	四川长虹	2,398,914.00	2.67
69	000571	新大洲A	2,396,699.37	2.66
70	300359	全通教育	2,393,498.86	2.66
71	601179	中国西电	2,390,709.36	2.66
72	600647	同达创业	2,385,197.00	2.65
73	601318	中国平安	2,363,282.00	2.63
74	000732	泰禾集团	2,361,127.13	2.62
75	600189	吉林森工	2,330,424.21	2.59
76	600751	天海投资	2,320,038.49	2.58
77	600563	法拉电子	2,292,351.11	2.55
78	000786	北新建材	2,281,068.00	2.53
79	601788	光大证券	2,276,440.95	2.53
80	600026	中远海能	2,240,058.00	2.49
81	002067	景兴纸业	2,230,451.48	2.48
82	600362	江西铜业	2,216,379.00	2.46
83	603026	石大胜华	2,205,147.00	2.45
84	000601	韶能股份	2,203,771.29	2.45
85	000550	江铃汽车	2,202,091.00	2.45
86	002458	益生股份	2,183,304.66	2.43
87	300520	科大国创	2,164,150.81	2.40
88	002707	众信旅游	2,157,763.14	2.40
89	300533	冰川网络	2,156,742.85	2.40
90	300474	景嘉微	2,135,159.75	2.37
91	000973	佛塑科技	2,132,084.71	2.37
92	300522	世名科技	2,128,889.36	2.37
93	002801	微光股份	2,125,142.13	2.36
94	600606	绿地控股	2,119,019.00	2.35
95	300431	暴风集团	2,062,237.96	2.29
96	600064	南京高科	2,056,966.00	2.29

97	603128	华贸物流	2,042,614.16	2.27
98	600997	开滦股份	2,030,406.65	2.26
99	000625	长安汽车	2,029,763.47	2.26
100	000969	安泰科技	2,027,841.53	2.25
101	600115	东方航空	1,961,294.85	2.18
102	600517	置信电气	1,960,142.00	2.18
103	002325	洪涛股份	1,958,385.38	2.18
104	000876	新希望	1,955,807.00	2.17
105	600285	羚锐制药	1,942,423.30	2.16
106	002004	华邦健康	1,936,799.00	2.15
107	000895	双汇发展	1,925,295.00	2.14
108	000915	山大华特	1,916,444.00	2.13
109	000848	承德露露	1,915,996.86	2.13
110	000488	晨鸣纸业	1,911,928.00	2.12
111	600984	建设机械	1,911,750.04	2.12
112	300146	汤臣倍健	1,908,995.97	2.12
113	600300	维维股份	1,903,728.29	2.12
114	600782	新钢股份	1,900,814.00	2.11
115	601699	潞安环能	1,900,315.00	2.11
116	601636	旗滨集团	1,896,395.25	2.11
117	300383	光环新网	1,889,634.00	2.10
118	600057	象屿股份	1,886,303.00	2.10
119	601766	中国中车	1,884,083.00	2.09
120	600892	大晟文化	1,882,746.84	2.09
121	600583	海油工程	1,879,957.00	2.09
122	002157	正邦科技	1,876,620.81	2.09
123	600690	青岛海尔	1,875,747.00	2.08
124	600409	三友化工	1,871,469.00	2.08
125	002152	广电运通	1,871,228.00	2.08
126	600797	浙大网新	1,850,681.94	2.06
127	000718	苏宁环球	1,850,340.90	2.06
128	600739	辽宁成大	1,846,330.00	2.05
129	600856	中天能源	1,845,710.00	2.05
130	300047	天源迪科	1,845,551.54	2.05
131	600704	物产中大	1,845,290.80	2.05
132	002416	爱施德	1,841,882.24	2.05
133	000627	天茂集团	1,839,866.16	2.04
134	002344	海宁皮城	1,838,366.47	2.04

135	600502	安徽水利	1,835,693.00	2.04
136	603800	道森股份	1,832,096.00	2.04
137	600761	安徽合力	1,828,960.00	2.03
138	000951	中国重汽	1,828,707.32	2.03
139	600819	耀皮玻璃	1,826,948.00	2.03
140	600338	西藏珠峰	1,825,797.00	2.03
141	600153	建发股份	1,824,616.01	2.03
142	000626	如意集团	1,822,202.00	2.02
143	601020	华钰矿业	1,820,964.81	2.02
144	601038	一拖股份	1,820,456.00	2.02
145	600113	浙江东日	1,816,384.00	2.02
146	600433	冠豪高新	1,808,770.00	2.01
147	603822	嘉澳环保	1,807,760.56	2.01
148	600416	湘电股份	1,807,414.47	2.01

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	664,583,133.45
卖出股票收入（成交）总额	677,520,656.80

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	85,674.35
2	应收证券清算款	21,575.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,962.64
5	应收申购款	10,735.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	116,022.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600734	实达集团	1,258,425.00	1.23	重大事项
2	600657	信达地产	1,216,512.00	1.19	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,399	60,466.01	74,347,966.97	87.89%	10,243,975.90	12.11%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	62,996.35	0.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年4月25日）基金份额总额	11,007,264.31
本报告期期初基金份额总额	72,320,067.59
本报告期基金总申购份额	92,840,743.65
减：本报告期基金总赎回份额	80,568,868.37
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	84,591,942.87

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产以及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未变更为其提供审计服务的会计事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
国金证券股 份有限公司	2	194,265,146.01	14.49%	180,916.95	15.50%	-
方正证券股 份有限公司	5	180,514,574.26	13.46%	132,005.58	11.31%	-
长江证券股 份有限公司	2	179,885,621.82	13.42%	167,527.39	14.35%	-
东吴证券股 份有限公司	3	157,833,679.96	11.77%	115,425.49	9.89%	-
东莞证券股 份有限公司	1	119,198,076.96	8.89%	111,007.89	9.51%	-
上海华信证 券有限责任 公司	1	93,390,229.81	6.97%	86,974.23	7.45%	-
中泰证券股 份有限公司	1	89,225,768.25	6.65%	83,095.77	7.12%	-
东北证券股 份有限公司	4	88,614,359.50	6.61%	82,527.28	7.07%	-
华泰证券股 份有限公司	5	69,388,760.42	5.18%	50,744.40	4.35%	-
西南证券股 份有限公司	2	48,063,033.11	3.58%	44,761.21	3.84%	新增 1 个 交易单元
天风证券股 份有限公司	4	42,746,131.38	3.19%	39,712.97	3.40%	新增 3 个 交易单元
北京高华证 券有限责任 公司	1	20,518,247.67	1.53%	19,108.56	1.64%	-
招商证券股 份有限公司	2	20,381,758.60	1.52%	18,972.40	1.63%	-
中国国际金 融有限公司	2	17,669,378.14	1.32%	16,455.31	1.41%	-
渤海证券股 份有限公司	1	8,215,390.56	0.61%	7,650.91	0.66%	-
第一创业证 券股份有限 公司	2	6,788,803.95	0.51%	6,314.72	0.54%	-
东方证券股 份有限公司	3	2,562,047.00	0.19%	2,386.01	0.20%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	1,591,482.00	0.12%	1,482.16	0.13%	-
民生证券有	2	-	-	-	-	-

限责任公司						
平安证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
南京证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	新增 1 个 交易单元
瑞银证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	0	-	-	-	-	撤销 1 个 交易单元
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 (山东) 有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广州证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	2	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例

				的比例		
国金证券股份有限公司	-	-	78,000,000.00	46.99%	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券股份有限公司	-	-	88,000,000.00	53.01%	-	-
上海华信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

平安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
南京证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
首创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中原证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集 团股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国民族证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有	-	-	-	-	-	-

限责任公司						
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《银华基金管理股份有限公司 2016 年 12 月 31 日基金净值公 告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2017 年 1 月 3 日
2	《银华量化智慧动力灵活配置混	三大证券报及本基	2017 年 1 月 21 日

	合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告》	金管理人网站	
3	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 23 日
4	《银华基金关于增加上海华信证券为旗下部分基金代销机构公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 24 日
5	《关于增加凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 28 日
6	《关于增加天津国美基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参加其费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 2 月 28 日
7	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 9 日
8	《关于旗下部分基金参加上海华信证券费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 18 日
9	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司网上费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 21 日
10	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
11	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告》	本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
12	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 3 月 31 日
13	《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 21 日
14	《银华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行渠道费率优惠活动的公告》	四大证券报及本基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
15	《银华基金管理股份有限公司关	四大证券报及本基	2017 年 6 月 1 日

	于增加上海华夏财富投资管理有 限公司为旗下部分基金代销机构 的公告》	金管理人网站	
16	《银华基金管理股份有限公司关于 增加上海通华财富资产管理有 限公司为旗下部分基金代销机构 并参与其优惠费率活动的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2017 年 6 月 1 日
17	《银华量化智慧动力灵活配置混 合型证券投资基金招募说明书 (2017 年第 1 号)》	本基金管理人网站	2017 年 6 月 9 日
18	《银华量化智慧动力灵活配置混 合型证券投资基金招募说明书摘 要(2017 年第 1 号)》	三大证券报及本基 金管理人网站	2017 年 6 月 9 日
19	《关于参加上海长量基金销售投 资顾问有限公司费率优惠的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2017 年 6 月 22 日
20	《银华基金管理股份有限公司关于 使用建设银行卡网上直销优惠 的公告》	四大证券报及本基 金管理人网站	2017 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/01/01 - 2017/06/20	47,219,400.90	31,273,651.29	78,493,052.19	0.00	0.00%
	2	2017/06/19 - 2017/06/30	0.00	58,674,769.48	0.00	58,674,769.48	69.36%
	3	2017/06/05	15,673,197.49	-	-	15,673,197.49	18.53%
	3	2017/01/01 - 2017/02/16	15,673,197.49	0.00	0.00	15,673,197.49	18.53%

产品特有风险

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特定风险，具体包括：

- 1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；
- 2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；
- 3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；
- 4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；
- 5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 12.1.1 银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金募集申请获中国证监会注册的文件
- 12.1.2 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华量化智慧动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理股份有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司

2017年8月29日