

光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 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 2016 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 |
| 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 8 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| 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..... | 9 |
| 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遵规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 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..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 14 |
| 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 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 15 |
| 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..... | 15 |
| 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） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| 7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 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..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 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..... | 45 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 45 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 45 |
| 8 基金份额持有人信息 | 46 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 46 |

| | | |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 47 |
| 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 | 47 |
| 9 | 开放式基金份额变动 | 47 |
| 10 | 重大事件揭示 | 47 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 | 47 |
| 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 | 48 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 48 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 | 48 |
| 10.5 | 报告期内改聘会计师事务所情况 | 48 |
| 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 | 48 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 48 |
| 10.8 | 其他重大事件 | 50 |
| 11 | 备查文件目录 | 52 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 52 |
| 11.2 | 存放地点 | 52 |
| 11.3 | 查阅方式 | 52 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|----------------------|------------------|
| 基金名称 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 光大保德信鼎鑫混合 | |
| 基金主代码 | 001464 | |
| 交易代码 | 001464 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 11 日 | |
| 基金管理人 | 光大保德信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国光大银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,204,202,632.21 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 光大保德信鼎鑫 A | 光大保德信鼎鑫 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 001464 | 001823 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,703,871,128.41 份 | 500,331,503.80 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金力争在股票、债券和现金等大类资产的灵活配置与稳健投资下，获取长期、持续、稳定的合理回报。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。</p> <p>（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；</p> <p>（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将结合自上而下行业分析与自下而上研究入库的投资理念，在以整个宏观策略为前提，把握结构性调整机会，将行业分析与个股精选相结合，寻找出表现优异的子行业和优质个股，并将这些股票组成本基金的核心股票库。</p> <p>（1）行业分析</p> <p>在综合考虑行业的周期、竞争格局、技术进步、政府政策、社会习惯的改变等因素后，精选出行业地位高、行业的发展空间大的子行业。</p> <p>（2）个股选择</p> <p>本基金将在核心股票库的基础上，以定性和定量相结合的方式，从价值和</p> |

成长等因素对个股进行选择,综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平,精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。同时,本基金关注国家相关政策、事件可能对上市公司的当前或未来价值产生的重大影响,本基金将在深入挖掘这类政策、事件的基础上,对行业进行优化配置和动态调整。

1) 定量分析

本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标,对目标上市公司的价值进行深入挖掘,并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析,为个股选择提供依据。

2) 定性分析

本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定,还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 等定性因素,给予股票一定的折溢价水平,并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果,本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票,本基金将重点关注;对于价值被高估但成长性良好,或价值被低估但成长性较差的股票,本基金将通过深入的调研和缜密的分析,有选择地进行投资;对于价值被高估且成长性较差的股票,本基金不予考虑投资。

3、固定收益类品种投资策略

本基金投资于固定收益类品种的目的在于保证基金资产流动性的基础上,使基金资产得到更加合理有效的利用,从而提高投资组合收益。为此,本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内,根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势,同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析,在严格控制风险的前提下,构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时,本基金将根据市场对于个券的市场成交情况,对各个目标投资对象进行利差分析,包括信用利差,流动性利差,期权调整利差(OAS),并利用利率模型对利率进行模拟预测,选出定价合理或被低估,到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。

4、股指期货投资策略

本基金将在风险可控的前提下,以套期保值为目的,根据对现货和期货市场的分析,充分考虑股指期货的风险收益特征,通过多头或空头的套期保值策略,以改善投资组合的投资效果,实现股票组合的超额收益。

5、国债期货投资策略

基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投资,以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。

6、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债相比,中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,整体流动性相对较差,而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。因此,对于中

| | |
|--------|--|
| | <p>小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。</p> <p>7、证券公司短期公司债券投资策略 本基金通过对证券公司短期公司债券发行人基本面的深入调研分析，结合发行人资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性以及债券流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券进行投资。</p> <p>8、资产支持证券投资策略 资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>9、权证及其他品种投资策略 本基金在权证投资中将权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。 同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理工作。</p> |
| 业绩比较基准 | 一年期银行定期存款收益率（税后）+ 3% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。 |

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 | | 光大保德信基金管理有限公司 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 魏丹 | 张建春 |
| | 联系电话 | 021-80262888-605 | 010-63639180 |
| | 电子邮箱 | epfservice@epf.com.cn | zhangjianchun@cebbank.com |
| 客户服务电话 | | 4008-202-888 | 95595 |
| 传真 | | 021-80262468 | 010-63639132 |
| 注册地址 | | 上海市延安东路222号外滩中心46楼 | 北京市西城区太平桥大街25号 |
| 办公地址 | | 上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层 | 北京市西城区太平桥大街25号 |
| 邮政编码 | | 200010 | 100045 |

| | | |
|-------|----|-----|
| 法定代表人 | 林昌 | 唐双宁 |
|-------|----|-----|

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 | www.epf.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|---------------|---|
| 注册登记机构 | 光大保德信基金管理有限公司 | 上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日） | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 光大保德信鼎鑫 A | 光大保德信鼎鑫 C |
| 本期已实现收益 | 7,762,071.78 | 1,307,363.35 |
| 本期利润 | -40,080,226.70 | -1,196,953.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0154 | -0.0024 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.54% | -0.24% |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.10% | -0.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) | |
| | 光大保德信鼎鑫 A | 光大保德信鼎鑫 C |
| 期末可供分配利润 | 3,020,563.68 | -1,804,356.46 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0018 | -0.0036 |
| 期末基金资产净值 | 1,724,739,638.96 | 503,232,637.88 |
| 期末基金份额净值 | 1.012 | 1.006 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日) | |
| | 光大保德信鼎鑫 A | 光大保德信鼎鑫 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.20% | 0.60% |

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）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

光大保德信鼎鑫 A

| 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 | 0.80% | 0.09% | 0.36% | 0.00% | 0.44% | 0.09% |
| 过去三个月 | 0.60% | 0.11% | 1.10% | 0.00% | -0.50% | 0.11% |
| 过去六个月 | -0.10% | 0.18% | 2.22% | 0.00% | -2.32% | 0.18% |
| 过去一年 | 1.50% | 0.17% | 4.63% | 0.00% | -3.13% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.20% | 0.16% | 4.92% | 0.00% | -3.72% | 0.16% |

光大保德信鼎鑫 C

| 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 | 0.80% | 0.08% | 0.36% | 0.00% | 0.44% | 0.08% |
| 过去三个月 | 0.60% | 0.10% | 1.10% | 0.00% | -0.50% | 0.10% |
| 过去六个月 | -0.20% | 0.17% | 2.22% | 0.00% | -2.42% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.60% | 0.17% | 2.85% | 0.00% | -2.25% | 0.17% |

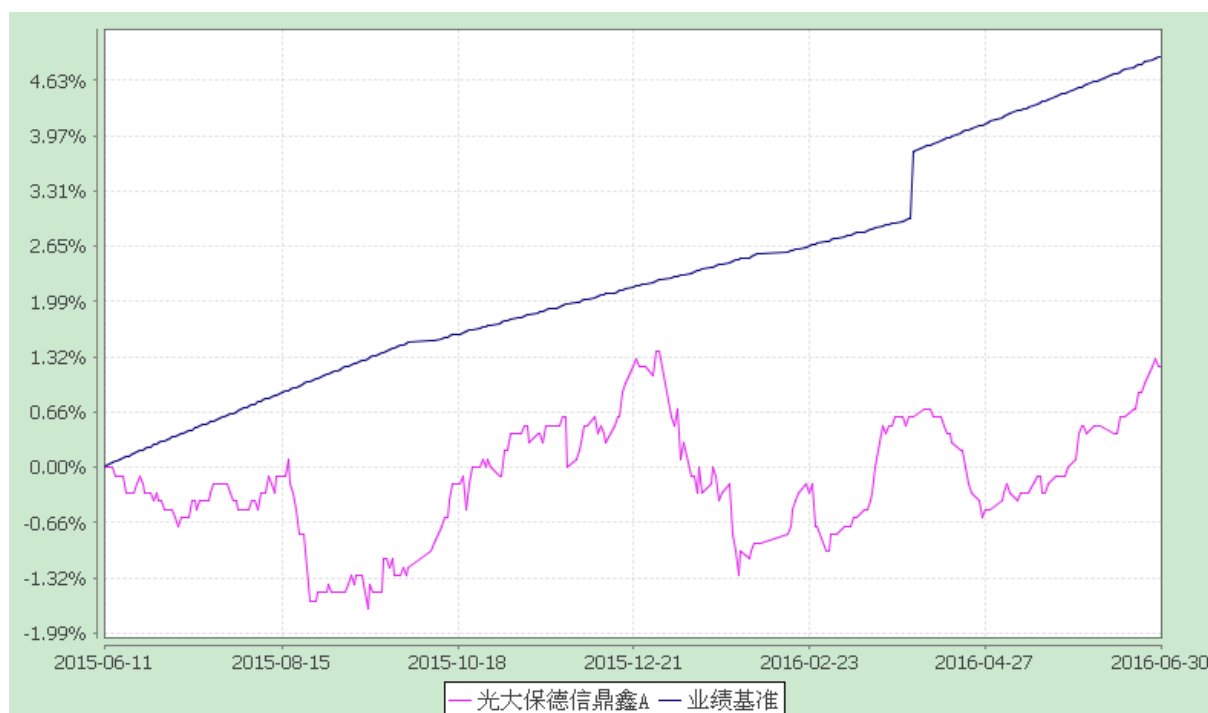
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金

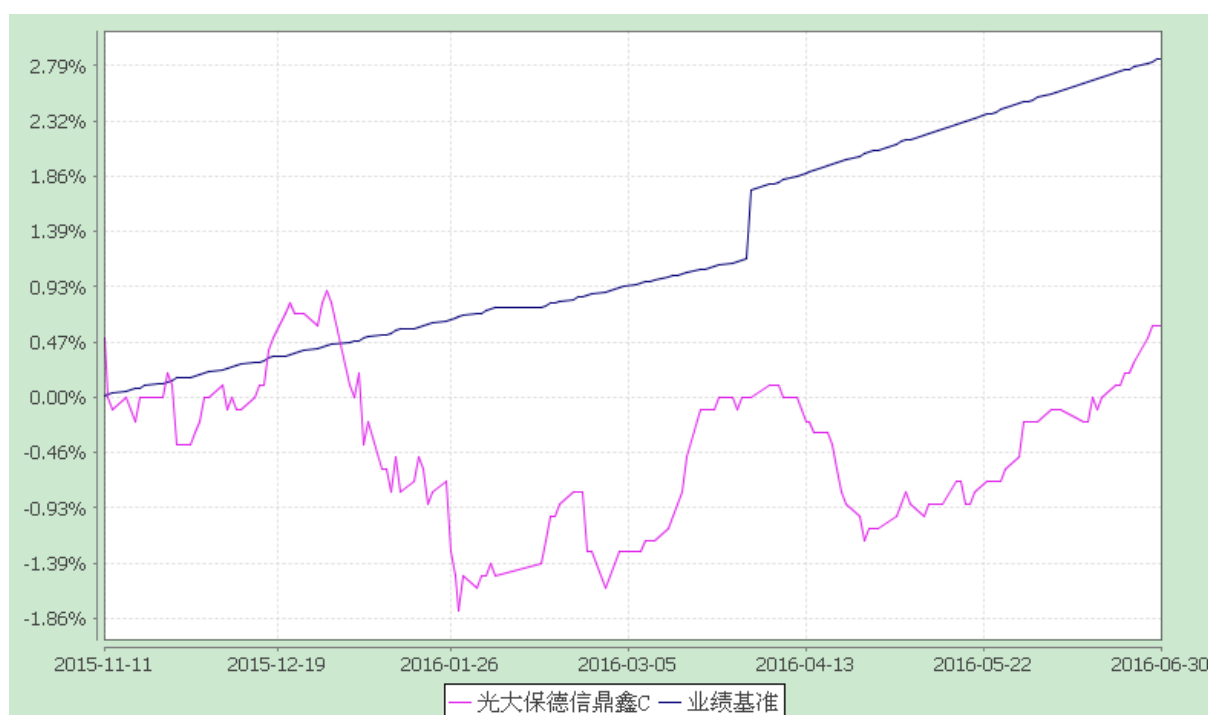
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 6 月 11 日至 2016 年 6 月 30 日)

光大保德信鼎鑫 A



光大保德信鼎鑫 C



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 12 月 10 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围

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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2016 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 24 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊享一年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金和光大保德信风格轮动混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 蔡乐 | 基金经理 | 2015-06-11 | - | 12 年 | 蔡乐女士，金融投资学学士。2003 年 7 月至 2005 年 2 月任方正证券固定收益部项目经理；2005 年 3 月至 2014 年 8 月历任中再资产管理股份有限公司固定收益部研究员兼交易员、投资经理助理、自有账户投资经理。2014 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现 |

| | | | | | |
|----|------|------------|---|-----|--|
| | | | | | 任光大保德信现金宝货币市场基金基金经理、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金基金经理、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信耀钱包货币市场基金基金经理、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 何奇 | 基金经理 | 2016-02-23 | - | 4 年 | 何奇先生，2010 年获得武汉大学经济学、法学双学士学位，2012 年获得武汉大学经济学硕士学位。2012 年 7 月至 2014 年 5 月在长江证券担任分析师、高级分析师；2014 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司，担任投资研究部研究员、高级研究员，并于 2015 年 6 月起担任光大保德信优势配置混合型证券投资基金的基金经理助理。现任光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

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

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和

完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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

2016 年上半年，美国经济保持弱复苏格局，日本和欧洲经济增长缓慢，而英国脱欧事件导致全球避险情绪升温，黄金、美元等大幅上涨，德国、日本等已经进入负利率时代，美联储加息预期一再延后，全球经济增长预期进一步下调。国内经济在年初的天量信贷刺激下保持了稳定的增长，工业企业经历了去库存小周期，企业盈利有所好转，但企业再投资意愿低迷，制造业投资未见显著回升，经济在房地产投资和基建投资拉动下保持了平稳增长的态势。上半年通胀水平前高后低，汇率贬值压力不减，货币政策保持中性稳健，央行不断通过公开市场操作日常化以及 MLF 操作常态化呵护资金面，保证了货币市场资金的稳定。债券市场在经济和通胀预期波动下表现为震荡行情，利率债收益率先升后降，总体保持小幅上行，信用债 4 月份受中铁物资等信用事件影响出现了较大幅度调整，高等级收益率整体小幅上行，中低等级收益率小幅下行。2016 年上半年中债综合全价（总值）指数下跌 0.02%。权益市场经历了年初的熔断风险后，春节后逐渐回升，结构化行情特征突出，整体体现出宽幅震荡的走势。

本报告期内，本基金保持了仓位调整的灵活性，组合配置上重点增加了信用债券和利率债券的仓位，适当降低股票仓位。同时适当拉长组合久期。权益部分严格按照绝对收益的操作思路，通过审慎和积极的管理，在把握流动性的基础上，积极努力为投资者赚取较高收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大保德信鼎鑫灵活配置 A 份额净值增长率为-0.10%，业绩比较基准收益率为 2.22%，光大保德信鼎鑫灵活配置 C 份额净值增长率为-0.20%，业绩比较基准收益率为 2.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国经济虽然保持了弱复苏格局，但近期政治黑天鹅事件频出，导致国际风险偏

好持续降低，同时，不景气的欧洲经济也引发市场对各国货币的宽松预期，对债市形成利好。国内经济增长压力依然较大，房地产销售和投资增速连续回落，加之去年下半年的高基数，下半年房地产的增速可能明显回落。基建投资面临下行压力，民间投资增速回升乏力，经济增长压力将进一步加大。通胀预计下半年前低后高，保持温和增长。但在去产能、去杠杆的大背景下，预计货币政策将继续维持稳健。在基本面的推动下，预期债券市场将保持慢牛格局，收益率中枢进一步下行，但信用风险仍对市场造成影响，信用利差有扩大的可能。权益市场仍将维持震荡格局，主题性行情仍将为市场提供绝对收益机会。

操作方面，本基金在兼顾收益性、流动性的前提下，会适时调整各类资产的投资比例。操作上把平衡性作为第一位，谨慎投资，力求在投资标的种类、比例方面做到平衡，在控制组合风险的基础上，为投资者积极赚取收益。

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，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本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的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性，估值委员会中的投研人员比例不超过三分之一。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值

委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现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

中国光大银行股份有限公司在光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对光大保德信量化核心证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司编制的“光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

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：光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | - | - |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 35,384,187.74 | 210,989,666.79 |
| 结算备付金 | | 4,722,669.75 | 1,779,896.23 |
| 存出保证金 | | 734,961.52 | 599,008.21 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,113,082,605.99 | 3,517,561,096.76 |
| 其中：股票投资 | | 120,141,605.99 | 406,663,820.36 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,992,941,000.00 | 3,110,897,276.40 |
| 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 | 99,650,509.83 | 1,771,305,616.95 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 41,516,970.30 | 49,234,431.90 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 311.13 | 3,331.48 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 2,295,092,216.26 | 5,551,473,048.32 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | 上年度末 2015 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 | | 37,000,000.00 | 1,100,998,293.50 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付证券清算款 | | 24,227,161.15 | - |
| 应付赎回款 | | 2,895,874.20 | 31,595,203.17 |
| 应付管理人报酬 | | 1,476,016.33 | 3,260,242.43 |
| 应付托管费 | | 369,004.07 | 815,060.59 |
| 应付销售服务费 | | 102,573.54 | 140,838.24 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 842,082.33 | 430,572.35 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | 7,231.79 | 76,277.61 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 199,996.01 | 270,000.00 |
| 负债合计 | | 67,119,939.42 | 1,137,586,487.89 |
| 所有者权益： | | - | - |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 2,204,202,632.21 | 4,358,288,031.20 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 23,769,644.63 | 55,598,529.23 |
| 所有者权益合计 | | 2,227,972,276.84 | 4,413,886,560.43 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,295,092,216.26 | 5,551,473,048.32 |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.011 元，基金份额总额 2,204,202,632.21 份。

其中 A 类基金份额总额 1,703,871,128.41 份，基金份额净值 1.012 元；C 类基金份额总额 500,331,503.80 份，基金份额净值 1.006 元。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2015 年 6 月 11 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、收入 | | -19,330,768.36 | -12,203,342.38 |
| 1.利息收入 | 6.4.7.11 | 52,640,257.41 | 5,469,746.74 |
| 其中：存款利息收入 | | 1,993,065.09 | 747,592.03 |
| 债券利息收入 | | 48,221,902.99 | 215,402.32 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 2,425,289.33 | 4,506,752.39 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -21,627,601.01 | -2,666,132.97 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -18,398,535.39 | -2,704,896.22 |
| 基金投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.14 | -3,589,484.70 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.18 | 360,419.08 | 38,763.25 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.19 | -50,346,615.61 | -15,057,329.45 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 3,190.85 | 50,373.30 |
| 减：二、费用 | | 21,946,412.12 | 2,212,347.75 |
| 1. 管理人报酬 | | 12,496,361.81 | 1,655,493.30 |
| 2. 托管费 | | 3,124,090.43 | 413,873.34 |
| 3. 销售服务费 | | 618,782.68 | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.21 | 3,542,448.98 | 116,510.31 |
| 5. 利息支出 | | 1,946,814.06 | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,946,814.06 | - |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.22 | 217,914.16 | 26,470.80 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -41,277,180.48 | -14,415,690.13 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -41,277,180.48 | -14,415,690.13 |

注：本基金合同生效于 2015 年 6 月 11 日，故上年度可比期间为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 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） | 4,358,288,031.20 | 55,598,529.23 | 4,413,886,560.43 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -41,277,180.48 | -41,277,180.48 |
| 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） | -2,154,085,398.99 | 9,448,295.88 | -2,144,637,103.11 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,383,414.22 | -3,491.41 | 1,379,922.81 |
| 2.基金赎回款 | -2,155,468,813.21 | 9,451,787.29 | -2,146,017,025.92 |
| 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） | 2,204,202,632.21 | 23,769,644.63 | 2,227,972,276.84 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |
| | 2015 年 6 月 11 日（基金合同生效日）至 2015 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） | 3,497,594,496.03 | - | 3,497,594,496.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -14,415,690.13 | -14,415,690.13 |
| 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） | 2,455,165,366.43 | -4,370,331.00 | 2,450,795,035.43 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,461,790,861.50 | -4,390,129.87 | 2,457,400,731.63 |
| 2.基金赎回款 | -6,625,495.07 | 19,798.87 | -6,605,696.20 |
| 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） | 5,952,759,862.46 | -18,786,021.13 | 5,933,973,841.33 |

注：本基金合同生效于 2015 年 6 月 11 日，故上年度可比期间为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 30 日。

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：

基金管理人负责人：林昌，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），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[2015]1110 号《关于准予光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司自 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 9 日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2015）验字第 60467078_B08 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 6 月 11 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集

的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,497,537,217.39 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 57,278.64 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 3,497,594,496.03 元，折合 3,497,594,496.03 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。本基金自 2015 年 11 月 11 日起增加 C 类基金份额，本基金原基金份额转为 A 类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者申购时需缴纳申购费，赎回基金份额时缴纳赎回费；对于 C 类基金份额，投资者申购时无需缴纳申购费，而从 C 类基金资产中收取销售服务费，赎回基金份额时缴纳赎回费。

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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、固定收益类金融工具（包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、货币市场工具、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等）、权证、股指期货、国债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相关规定）。

本基金股票资产占基金资产的比例范围为 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款收益率（税后）+ 3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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（以下合称“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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日止期间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

本基金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。

6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2016 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 35,384,187.74 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 35,384,187.74 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | | 2016 年 6 月 30 日 | | |
|---------------|-------|------------------|------------------|---------------|
| | | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 114,543,058.31 | 120,141,605.99 | 5,598,547.68 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,082,430,229.02 | 1,092,260,500.00 | 9,830,270.98 |
| | 银行间市场 | 895,079,511.67 | 900,680,500.00 | 5,600,988.33 |
| | 合计 | 1,977,509,740.69 | 1,992,941,000.00 | 15,431,259.31 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,092,052,799.00 | 2,113,082,605.99 | 21,029,806.99 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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 2016 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 99,650,509.83 | - |
| 合计 | 99,650,509.83 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 12,123.10 |
| 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 | 1,912.68 |
| 应收债券利息 | 41,481,188.98 |
| 应收买入返售证券利息 | 21,438.07 |
| 应收申购款利息 | 9.84 |

| | |
|------------|---------------|
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 297.63 |
| 合计 | 41,516,970.30 |

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 833,335.44 |
| 银行间市场应付交易费用 | 8,746.89 |
| 合计 | 842,082.33 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 17.70 |
| 其他 | 1,074.15 |
| 应付银行划款手续费 | - |
| 应付转出费 | - |
| 预提审计费 | 49,726.04 |
| 预提信息披露费 | 149,178.12 |
| 合计 | 199,996.01 |

6.4.7.9 实收基金

光大保德信鼎鑫 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|-------------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,857,420,396.05 | 3,857,420,396.05 |
| 本期申购 | 677,267.05 | 677,267.05 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,154,226,534.69 | -2,154,226,534.69 |

| | | |
|-----|------------------|------------------|
| 本期末 | 1,703,871,128.41 | 1,703,871,128.41 |
|-----|------------------|------------------|

光大保德信鼎鑫 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 上年度末 | 500,867,635.15 | 500,867,635.15 |
| 本期申购 | 706,147.17 | 706,147.17 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,242,278.52 | -1,242,278.52 |
| 本期末 | 500,331,503.80 | 500,331,503.80 |

6.4.7.10 未分配利润

光大保德信鼎鑫 A

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 | -8,248,062.67 | 59,747,457.32 | 51,499,394.65 |
| 本期利润 | 7,762,071.78 | -47,842,298.48 | -40,080,226.70 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,506,554.57 | 5,942,788.03 | 9,449,342.60 |
| 其中：基金申购款 | -4,672.64 | 3,374.37 | -1,298.27 |
| 基金赎回款 | 3,511,227.21 | 5,939,413.66 | 9,450,640.87 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,020,563.68 | 17,847,946.87 | 20,868,510.55 |

光大保德信鼎鑫 C

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 | -3,115,095.43 | 7,214,230.01 | 4,099,134.58 |
| 本期利润 | 1,307,363.35 | -2,504,317.13 | -1,196,953.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,375.62 | -4,422.34 | -1,046.72 |
| 其中：基金申购款 | -6,853.94 | 4,660.80 | -2,193.14 |
| 基金赎回款 | 10,229.56 | -9,083.14 | 1,146.42 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -1,804,356.46 | 4,705,490.54 | 2,901,134.08 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 300,554.23 |
| 定期存款利息收入 | 1,527,788.92 |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 160,165.15 |
| 其他 | 4,556.79 |
| 合计 | 1,993,065.09 |

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,245,023,931.67 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,263,422,467.06 |
| 买卖股票差价收入 | -18,398,535.39 |

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -3,589,484.70 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -3,589,484.70 |

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,538,191,632.81 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,489,024,292.85 |
| 减：应收利息总额 | 52,756,824.66 |

| | |
|---------------------------|---------------|
| 买卖债券（、债转股及债券到期兑付） 差价收入 | -3,589,484.70 |
|---------------------------|---------------|

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 360,419.08 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 360,419.08 |

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -50,346,615.61 |
| ——股票投资 | -43,095,202.06 |
| ——债券投资 | -7,251,413.55 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 合计 | -50,346,615.61 |

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
| | |

| | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|---------|----------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,432.62 |
| 转换费收入 | 758.23 |
| 合计 | 3,190.85 |

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 3,528,436.48 |
| 银行间市场交易费用 | 14,012.50 |
| 合计 | 3,542,448.98 |

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用 | 49,726.04 |
| 信息披露费 | 149,178.12 |
| 帐户维护费 | 18,000.00 |
| 其他费用 | 1,010.00 |
| 合计 | 217,914.16 |

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，本基金无需要披露的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 |
|--------------------------|---------------------|
| 光大保德信基金管理有限公司（简称“光大保德信”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国光大银行股份有限公司（简称“光大银行”） | 基金托管人、基金代销机构 |
| 光大证券股份有限公司（简称“光大证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

注：下述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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年6月11日（基金合同生效日） 至2015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 |
| 光大证券 | 94,715,706.81 | 4.19% | 102,142,876.39 | 100.00% |

注：本基金合同生效于 2015 年 6 月 11 日，故上年度可比期间为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年6月11日（基金合同生效日） 至2015年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------------|---|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期债 券成交总 额的比例 | 成交金额 | 占当期债 券成交总 额的比例 |
| 光大证券 | 589,971,864.67 | 94.69% | 232,469,906.00 | 100.00% |

注：本基金合同生效于 2015 年 6 月 11 日，故上年度可比期间为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 30 日。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
| | | |

| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 2015年6月11日（基金合同生效日） 至2015年6月30日 | |
|------|----------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 光大证券 | 0.00 | 0.00% | 20,159,300,000.00 | 100.00% |

注：本基金合同生效于 2015 年 6 月 11 日，故上年度可比期间为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 30 日。

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 2016年1月1日至2016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 |
| 光大证券 | 86,314.58 | 4.15% | 0.00 | 0.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2015年6月11日（基金合同生效日）至2015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 |
| 光大证券 | 91,549.44 | 100.00% | 91,549.44 | 100.00% |

注：本基金合同生效于 2015 年 6 月 11 日，故上年度可比期间为 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 30 日。

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | 上年度可比期间 2015年6月11日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,496,361.81 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 486,561.06 | 122,518.05 |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年6月11日（基金合同生效日）至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 3,124,090.43 | 413,873.34 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|--------------------------------|------------|------------|
| | 2016年1月1日至2016年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 光大保德信鼎鑫 A | 光大保德信鼎鑫 C | 合计 |
| 光大保德信 | - | 618,548.73 | 618,548.73 |
| 光大证券 | - | - | - |
| 光大银行 | - | - | - |
| 合计 | - | 618,548.73 | 618,548.73 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2015年6月11日（基金合同生效日）至2015年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 光大保德信鼎鑫A | 光大保德信鼎鑫C | 合计 |
| 合计 | - | - | - |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金 C 类基金份额的销售与基金份额持有人服务，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金前一日的基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)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

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

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

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投资本基金。

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 2016年1月1日至2016年6月30日 | | 上年度可比期间 2015年6月11日（基金合同生效 日）至2015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 |
| 光大银行 | 35,384,187.74 | 300,554.23 | 7,192,138.56 | 302,908.41 |

注：本基金的活期存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016 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 |
| 601966 | 玲珑轮胎 | 2016-06-24 | 2016-07-06 | 新股未上市 | 12.98 | 12.98 | 15,341.00 | 199,126.18 | 199,126.18 | - |
| 603016 | 新宏泰 | 2016-06-23 | 2016-07-01 | 新股未上市 | 8.49 | 8.49 | 1,602.00 | 13,600.98 | 13,600.98 | - |
| 002805 | 丰元股份 | 2016-06-29 | 2016-07-07 | 新股未上市 | 5.80 | 5.80 | 971.00 | 5,631.80 | 5,631.80 | - |
| 300520 | 科大国创 | 2016-06-30 | 2016-07-08 | 新股未上市 | 10.05 | 10.05 | 926.00 | 9,306.30 | 9,306.30 | - |

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(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|------------|---------------|--------------|----|
| 000002 | 万科A | 2015-12-21 | 重大事项 | 18.21 | 2016-07-04 | 21.11 | 500,000.00 | 10,134,700.00 | 9,105,000.00 | - |
| 600759 | 洲际油气 | 2016-06-27 | 重大事项 | 7.58 | 2016-07-11 | 8.09 | 48,370.00 | 377,106.00 | 366,644.60 | - |

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 37,000,000.00 元,于 2016 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次:第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门;第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会;第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者,负责根据公司风险管理政策和制度,制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任,并报请风险管理工作委员会审议批准;对本部门的主要风险指标,以及相关的测量、管理方法提出建议,并及时更新,报请风险管理工作委员会审议批准;实施本部门的风险管理日常工作,定期进行自我评估,并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构,根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权,负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构,其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

本基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统,可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

6.4.13.2 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证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不

得超过该证券的 10%。

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。

6.4.13.3 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，本期末本基金的资产均能及时变现。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。

本基金管理人风险管理部门从资产配置、行业配置、个股选择等层面制定相应的流动性指标，设定相应的预警阈值，并通过风险评估系统对这些流动性指标进行持续的监测、评估，根据评估结果及时提出流动性风险管理建议。

本基金管理人通过设定对单一证券的投资比例限制，建立相应的授权审批制度，在保护基金持有人利益最大化的前提下，有效管理基金因在单一证券投资比例过高所带来的个股流动性风险。

本基金管理人通过制定流通受限证券的投资流程及风险处置预案，有效管理基金投资流通受限证券所承受的流动性风险。

本基金管理人通过分析本基金持有人结构、密切跟踪监控基金申购赎回趋势，有效预测本基金的流动性需求。同时，本基金管理人通过进行基金变现能力测试得出基金在各市场情形下的变现能力，通过情景分析及压力测试，评估基金在极端情形下面临的流动性风险。

6.4.13.4 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、外汇风险及其他价格风险。

6.4.13.4.1 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证保证金及债券投资等。本基金

通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2016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 | 35,384,187.74 | - | - | - | - | - | 35,384,187.74 |
| 结算备付金 | 4,722,669.75 | - | - | - | - | - | 4,722,669.75 |
| 存出保证金 | 734,961.52 | - | - | - | - | - | 734,961.52 |
| 交易性金融资产 | 20,146,000.00 | 120,693,000.00 | 219,867,000.00 | 1,431,421,000.00 | 200,814,000.00 | 120,141,605.99 | 2,213,082,605.99 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 99,650,509.83 | - | - | - | - | - | 99,650,509.83 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 41,516,970.30 | 41,516,970.30 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 311.13 | 311.13 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 资产总计 | 160,638,328.84 | 120,693,000.00 | 219,867,000.00 | 1,431,421,000.00 | 200,814,000.00 | 161,658,887.42 | 2,295,092,216.26 |
| 负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 37,000,000.00 | - | - | - | - | - | 37,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 24,227,161.15 | 24,227,161.15 |

| | | | | | | | |
|--------------------------|------------------|----------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 2,895,874.20 | 2,895,874.20 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,476,016.33 | 1,476,016.33 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 369,004.07 | 369,004.07 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 102,573.54 | 102,573.54 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 842,082.33 | 842,082.33 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 7,231.79 | 7,231.79 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | 0.00 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 199,996.01 | 199,996.01 |
| 负债总计 | 37,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 30,119,939.42 | 67,119,939.42 |
| 利率敏感度缺口 | 123,638,328.84 | 120,693,000.00 | 219,867,000.00 | 1,431,421,000.00 | 200,814,000.00 | 131,538,948.00 | 2,227,972,276.84 |
| 上年度末 2015 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 | 210,989,666.79 | - | - | - | - | - | 210,989,666.79 |
| 结算备付金 | 1,779,896.23 | - | - | - | - | - | 1,779,896.23 |
| 存出保证金 | 599,008.21 | - | - | - | - | - | 599,008.21 |
| 交易性金融资产 | 0.00 | 301,200,000.00 | 684,742,028.20 | 2,044,909,051.20 | 80,046,197.00 | 406,663,820.36 | 3,517,561,096.76 |
| 衍生金融资产 | 0.00 | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 1,771,305.616.95 | - | - | - | - | - | 1,771,305.616.95 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | - | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | 0.00 | - | - | - | - | 49,234,431.90 | 49,234,431.90 |
| 应收股利 | 0.00 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | |
|-----------|--------------|------------|------------|--------------|------------|---------------|---------------|
| 应收申购款 | 1,200.00 | - | - | - | - | 2,131.48 | 3,331.48 |
| 其他资产 | 0.00 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 1,984,675.38 | 301,200.00 | 684,742.02 | 2,044,909.00 | 80,046.197 | 455,900.38 | 5,551,473.00 |
| | 88.18 | 0.00 | 8.20 | 51.20 | 00 | 3.74 | 48.32 |
| 负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 1,100,998.29 | - | - | - | - | - | 1,100,998.29 |
| | 93.50 | - | - | - | - | - | 93.50 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 31,595,203.17 | 31,595,203.17 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 3,260,242.43 | 3,260,242.43 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 815,060.59 | 815,060.59 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 140,838.24 | 140,838.24 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 430,572.35 | 430,572.35 |
| 应付税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - | 76,277.61 | 76,277.61 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 270,000.00 | 270,000.00 |
| 负债总计 | 1,100,998.29 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 36,588,194.39 | 1,137,586.40 |
| | 93.50 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 39 | 87.89 |
| 利率敏感度缺口 | 883,677.09 | 301,200.00 | 684,742.02 | 2,044,909.00 | 80,046.197 | 419,312.18 | 4,413,886.50 |
| | 4.68 | 0.00 | 8.20 | 51.20 | 00 | 9.35 | 60.43 |

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|--------------------------------|-----------------|------------------|
| 假设 | 资产净值变动与利率变动成负相关，相关系数为资产组合的货币久期 | | |
| 分析 | 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：人民币万元） | |
| | | 本期末 | 上年度末 |
| | | 2016 年 6 月 30 日 | 2015 年 12 月 31 日 |
| | 基准利率上升 1% | 减少约 4,785 | 减少约 7,918 |
| | 基准利率下降 1% | 增加约 4,785 | 增加约 7,918 |

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要系市场价格风险。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。

本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2016 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2015 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 | 120,141,605. 99 | 5.39 | 406,663,820.3 6 | 9.21 |

| | | | | |
|---------------|-------------------------|--------------|-------------------------|--------------|
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 1,992,941,000.00 | 89.45 | 3,110,897,276.40 | 70.48 |
| 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 | 2,113,082,605.99 | 94.84 | 3,517,561,096.76 | 79.69 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致 | | |
|----|----------------------------------|------------------------------|---------------------|
| 分析 | 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：人民币万元） | |
| | | 本期末 2016年6月30日 | 上年度末 2015年12月31日 |
| | 业绩比较基准上升 1% | 增加约 467 | 减少约 127,634 |
| | 业绩比较基准下降 1% | 减少约 467 | 增加约 127,634 |

注：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，将对基金净值产生的影响。

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 | 120,141,605.99 | 5.23 |
| | 其中：股票 | 120,141,605.99 | 5.23 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,992,941,000.00 | 86.83 |
| | 其中：债券 | 1,992,941,000.00 | 86.83 |
| | 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 | 99,650,509.83 | 4.34 |
| | 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 | 40,106,857.49 | 1.75 |
| 7 | 其他各项资产 | 42,252,242.95 | 1.84 |
| 8 | 合计 | 2,295,092,216.26 | 100.00 |

7.2 报告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

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 5,488,882.70 | 0.25 |
| C | 制造业 | 48,103,377.51 | 2.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 775,274.28 | 0.03 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 70,492.40 | 0.00 |
| J | 金融业 | 5,760,000.00 | 0.26 |
| K | 房地产业 | 9,105,000.00 | 0.41 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 20,126.10 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 50,818,453.00 | 2.28 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 120,141,605.99 | 5.39 |

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 | 000035 | 中国天楹 | 7,187,900.00 | 50,818,453.00 | 2.28 |
| 2 | 300196 | 长海股份 | 1,206,994.00 | 47,277,954.98 | 2.12 |
| 3 | 000002 | 万科A | 500,000.00 | 9,105,000.00 | 0.41 |
| 4 | 601288 | 农业银行 | 1,800,000.00 | 5,760,000.00 | 0.26 |
| 5 | 601857 | 中国石油 | 708,470.00 | 5,122,238.10 | 0.23 |
| 6 | 601611 | 中国核建 | 37,059.00 | 775,274.28 | 0.03 |
| 7 | 600759 | 洲际油气 | 48,370.00 | 366,644.60 | 0.02 |
| 8 | 601127 | 小康股份 | 8,662.00 | 206,761.94 | 0.01 |
| 9 | 601966 | 玲珑轮胎 | 15,341.00 | 199,126.18 | 0.01 |
| 10 | 603737 | 三棵树 | 1,327.00 | 154,038.16 | 0.01 |
| 11 | 603131 | 上海沪工 | 1,263.00 | 76,664.10 | 0.00 |
| 12 | 300515 | 三德科技 | 1,355.00 | 63,508.85 | 0.00 |
| 13 | 300518 | N 盛讯达 | 1,306.00 | 61,186.10 | 0.00 |
| 14 | 002799 | 环球印务 | 1,080.00 | 47,131.20 | 0.00 |
| 15 | 603958 | 哈森股份 | 2,372.00 | 34,394.00 | 0.00 |
| 16 | 002802 | 洪汇新材 | 1,629.00 | 24,565.32 | 0.00 |
| 17 | 603909 | 合诚股份 | 1,095.00 | 20,126.10 | 0.00 |
| 18 | 603016 | 新宏泰 | 1,602.00 | 13,600.98 | 0.00 |
| 19 | 300520 | 科大国创 | 926.00 | 9,306.30 | 0.00 |
| 20 | 002805 | 丰元股份 | 971.00 | 5,631.80 | 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 | 300059 | 东方财富 | 101,122,759.39 | 2.29 |
| 2 | 000035 | 中国天楹 | 79,400,785.69 | 1.80 |
| 3 | 300196 | 长海股份 | 60,766,232.45 | 1.38 |
| 4 | 300064 | 豫金刚石 | 48,863,214.10 | 1.11 |
| 5 | 601588 | 北辰实业 | 40,117,390.17 | 0.91 |
| 6 | 002588 | 史丹利 | 39,912,118.29 | 0.90 |
| 7 | 600038 | 中直股份 | 36,707,068.34 | 0.83 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 8 | 601688 | 华泰证券 | 31,721,015.60 | 0.72 |
| 9 | 300259 | 新天科技 | 29,746,689.91 | 0.67 |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 27,953,658.71 | 0.63 |
| 11 | 000939 | 凯迪生态 | 25,089,753.06 | 0.57 |
| 12 | 002367 | 康力电梯 | 23,858,289.62 | 0.54 |
| 13 | 002081 | 金螳螂 | 21,498,037.55 | 0.49 |
| 14 | 000903 | 云内动力 | 20,611,933.22 | 0.47 |
| 15 | 600114 | 东睦股份 | 19,254,517.74 | 0.44 |
| 16 | 600894 | 广日股份 | 19,015,224.87 | 0.43 |
| 17 | 600999 | 招商证券 | 18,647,067.09 | 0.42 |
| 18 | 600172 | 黄河旋风 | 17,550,582.40 | 0.40 |
| 19 | 300070 | 碧水源 | 16,941,580.62 | 0.38 |
| 20 | 600030 | 中信证券 | 16,715,215.00 | 0.38 |

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 | 300059 | 东方财富 | 113,722,791.58 | 2.58 |
| 2 | 300064 | 豫金刚石 | 51,185,798.01 | 1.16 |
| 3 | 002588 | 史丹利 | 45,532,993.22 | 1.03 |
| 4 | 601588 | 北辰实业 | 40,596,883.04 | 0.92 |
| 5 | 601688 | 华泰证券 | 35,979,100.50 | 0.82 |
| 6 | 600038 | 中直股份 | 35,884,687.09 | 0.81 |
| 7 | 300259 | 新天科技 | 30,996,773.78 | 0.70 |
| 8 | 000035 | 中国天楹 | 29,913,154.40 | 0.68 |
| 9 | 600837 | 海通证券 | 29,326,378.90 | 0.66 |
| 10 | 002081 | 金螳螂 | 24,895,693.82 | 0.56 |
| 11 | 002367 | 康力电梯 | 24,512,127.34 | 0.56 |
| 12 | 000939 | 凯迪生态 | 23,412,146.82 | 0.53 |
| 13 | 000903 | 云内动力 | 20,175,431.52 | 0.46 |
| 14 | 600114 | 东睦股份 | 19,771,419.54 | 0.45 |
| 15 | 600894 | 广日股份 | 18,908,871.51 | 0.43 |
| 16 | 600048 | 保利地产 | 18,274,780.80 | 0.41 |
| 17 | 600999 | 招商证券 | 18,212,287.69 | 0.41 |
| 18 | 600030 | 中信证券 | 18,033,642.00 | 0.41 |
| 19 | 600588 | 用友网络 | 17,156,613.87 | 0.39 |
| 20 | 300070 | 碧水源 | 16,972,122.87 | 0.38 |

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

| | |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 1,019,995,454.75 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,245,023,931.67 |

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 50,440,000.00 | 2.26 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 160,010,000.00 | 7.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 160,010,000.00 | 7.18 |
| 4 | 企业债券 | 1,000,587,500.00 | 44.91 |
| 5 | 企业短期融资券 | 210,832,000.00 | 9.46 |
| 6 | 中期票据 | 479,398,500.00 | 21.52 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 91,673,000.00 | 4.11 |
| 10 | 合计 | 1,992,941,000.00 | 89.45 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 112260 | 15 阳房 01 | 1,300,000 | 131,274,000.00 | 5.89 |
| 2 | 122430 | 15 增碧债 02 | 1,000,000 | 101,030,000.00 | 4.53 |
| 3 | 160204 | 16 国开 04 | 1,000,000 | 99,880,000.00 | 4.48 |
| 4 | 123304 | 14 华西次级债 01 | 800,000 | 82,736,000.00 | 3.71 |
| 5 | 136167 | 16 华夏债 | 800,000 | 80,392,000.00 | 3.61 |

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

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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

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

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

基金管理人可运用国债期货，以提高投资效率。本基金在国债期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的利率风险，改善组合的风险收益特性。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内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。

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 | 734,961.52 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 41,516,970.30 |
| 5 | 应收申购款 | 311.13 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 42,252,242.95 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的债券。

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 | 000002 | 万 科 A | 9,105,000.00 | 0.41 | 重大事项 |
| 2 | 600759 | 洲际油气 | 366,644.60 | 0.02 | 重大事项 |
| 3 | 601966 | 玲珑轮胎 | 199,126.18 | 0.01 | 新股未上市 |

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

| 份额级别 | 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 | |
| | | | | | | | |

| | | | | | | |
|-----------|-------|-------------------|----------------------|--------|----------------|--------|
| 光大保德信鼎鑫 A | 2,438 | 698,880.69 | 1,520,077,078. 16 | 89.21% | 183,794,050.25 | 10.79% |
| 光大保德信鼎鑫 C | 37 | 13,522,473. 08 | 500,000,000.00 | 99.93% | 331,503.80 | 0.07% |
| 合计 | 2,475 | 890,586.92 | 2,020,077,078. 16 | 91.65% | 184,125,554.05 | 8.35% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 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 | 光大保德信鼎鑫 A | 1,137,191.28 | 0.07% |
| | 光大保德信鼎鑫 C | 1.00 | 0.00% |
| | 合计 | 1,137,192.28 | 0.05% |

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

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 光大保德信鼎鑫 A | >100 |
| | 光大保德信鼎鑫 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 光大保德信鼎鑫 A | 0 |
| | 光大保德信鼎鑫 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 光大保德信鼎鑫 A | 光大保德信鼎鑫 C |
|--------------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015 年 6 月 11 日）基金份额总额 | 3,497,594,496.03 | 0.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,857,420,396.05 | 500,867,635.15 |
| 本报告期基金总申购份额 | 677,267.05 | 706,147.17 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,154,226,534.69 | 1,242,278.52 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,703,871,128.41 | 500,331,503.80 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

经公司八届二十一次董事会会议审议通过，自 2016 年 3 月 3 日起，陶耿先生正式离任公司总经理一职，由林昌先生代任公司总经理。经公司九届二次董事会会议审议通过，自 2016 年 7 月 19 日起，包爱丽女士正式担任公司总经理一职，林昌先生不再代任公司总经理，将继续担任公司董事长。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门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

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

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，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

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 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 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 | |
| 中泰证券 | 1 | 29,680,467.02 | 1.31% | 27,640.40 | 1.33% | - |
| 光大证券 | 2 | 94,715,706.81 | 4.19% | 86,314.58 | 4.15% | - |
| 中信建投 | 1 | 166,630,506.61 | 7.36% | 155,182.52 | 7.46% | - |
| 中投建银 | 1 | 189,237,734.80 | 8.36% | 172,452.93 | 8.29% | - |
| 国金证券 | 1 | 205,485,288.64 | 9.08% | 187,259.44 | 9.00% | - |
| 瑞银证券 | 1 | 218,680,572.68 | 9.66% | 199,284.13 | 9.58% | - |
| 银河证券 | 1 | 269,693,138.62 | 11.92% | 251,165.40 | 12.07% | - |
| 海通证券 | 1 | 272,521,612.81 | 12.04% | 248,349.05 | 11.94% | - |
| 国信证券 | 1 | 384,389,842.78 | 16.99% | 350,295.21 | 16.84% | - |
| 长江证券 | 1 | 431,890,324.08 | 19.09% | 402,218.49 | 19.34% | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本报告期内本基金租用的证券公司交易单元无变更。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

- 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；
- 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；
- 对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（1）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构。

董事会已做出决议，授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专用交易席位的事宜。

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 | | 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 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中泰证券 | - | - | 714,900,000.00 | 8.52% | - | - |
| 光大证券 | 589,971,864.67 | 94.69% | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | 1,484,400,000.00 | 17.70% | - | - |
| 中投建银 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 736,108.00 | 0.12% | - | - | - | - |
| 瑞银证券 | 1,070,685.00 | 0.17% | - | - | - | - |
| 银河证券 | 7,083,271.97 | 1.14% | 764,700,000.00 | 9.12% | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 24,168,390.68 | 3.88% | 5,423,200,000.00 | 64.66% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-04 |

| | | | |
|----|---|------------------------|------------|
| 2 | 关于旗下部分基金新增联讯证券股份有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-08 |
| 3 | 光大保德信基金管理有限公司新增海银基金销售有限公司为代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-14 |
| 4 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-20 |
| 5 | 关于旗下部分基金产品新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-20 |
| 6 | 关于旗下部分基金产品新增深圳新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-21 |
| 7 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-23 |
| 8 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-23 |
| 9 | 关于旗下部分基金产品新增上海利得基金销售有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-01-25 |
| 10 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-02-23 |
| 11 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为代销机构并参与其费用优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-03-17 |
| 12 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分产品新增申万宏源证券有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-03-18 |
| 13 | 光大保德信基金管理有限公司关于部分基金在中国光大银行股份有限公司开通定期定额投资及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-03-23 |
| 14 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国邮政储蓄银行开通定期定额投资及转换业务的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-03-23 |
| 15 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-03-28 |
| 16 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-03-28 |
| 17 | 光大保德信基金管理有限公司关于调整招商银行“一卡通”借记卡网上直销平台(含移动终端)交易费率的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-04-07 |
| 18 | 光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-04-22 |
| 19 | 关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-05-27 |

| | | | |
|----|--|------------------------|------------|
| | 动的公告 | | |
| 20 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分产品新增光大证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-06-01 |
| 21 | 光大保德信基金管理有限公司关于参与上海联泰资产管理有限公司申购费优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-06-18 |
| 22 | 光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参与其交易费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-06-24 |
| 23 | 光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2016-06-29 |

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层本基金管理人办公地址。

11.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日