

**光大保德信红利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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
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 .....	41
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 其他重大事件 .....	44
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>46</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	46

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信红利混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信红利混合
基金主代码	360005
交易代码	360005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 3 月 24 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	589,830,046.53 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对高分红类股票及其他具有投资价值的股票进行投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金为混合型投资基金，强调收益的当期实现与资产的长期增值。高分红类股票及其他具有投资价值的股票是本基金的主要投资对象。基金管理人将充分发挥自身的研究力量，利用公司研究开发的各种数量模型工具，采用科学的投资策略，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。
业绩比较基准	75%×上证红利指数+20%×中证全债指数+5%×银行活期存款利率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的风险较高的品种，其预期收益和风险高于债券型基金及货币市场基金。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	张志永
	联系电话	021-80262888-605	021-62677777
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4008-202-888	95561
传真		021-80262468	021-62159217
注册地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	福州市湖东路154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	上海市江宁路168号兴业大厦20层

邮政编码	200002	200041
法定代表人	林昌	高建平

## 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、兴业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）
本期已实现收益	-280,270,301.43
本期利润	-281,008,381.93
加权平均基金份额本期利润	-0.4664
本期加权平均净值利润率	-13.94%
本期基金份额净值增长率	-11.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	377,212,457.18
期末可供分配基金份额利润	0.6395
期末基金资产净值	1,690,476,013.17
期末基金份额净值	2.8660
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	439.65%

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

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	5.41%	1.23%	-1.39%	0.64%	6.80%	0.59%
过去三个月	3.97%	1.28%	-2.34%	0.70%	6.31%	0.58%
过去六个月	-11.61%	2.08%	-11.81%	1.34%	0.20%	0.74%
过去一年	-9.45%	2.33%	-24.33%	1.76%	14.88%	0.57%
过去三年	81.18%	1.79%	38.36%	1.42%	42.82%	0.37%
自基金合同生效起至今	439.65%	1.70%	127.33%	1.50%	312.32%	0.20%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×上证红利指数+20%×天相国债全价指数+5%×银行活期存款利率”变更为“75%×上证红利指数+20%×中证全债指数+5%×银行活期存款利率”。

#### 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

光大保德信红利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

(2006 年 3 月 24 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：1、为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×上证红利指数+20%×天相国债全价指数+5%×银行活期存款利率”变更为“75%×上证红利指数+20%×中证全债指数+5%×银行活期存款利率”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2006 年 3 月 24 日至 2006 年 9 月 23 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

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、光大保德信尊尚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		
戴奇雷	权益投资部总监、本基金基金经理	2013-05-21	-	14 年	戴奇雷先生, 华中理工大学理学硕士、中欧国际工商学院工商管理硕士。1995 年毕业于华中理工大学生物医学工程专业, 1998 年获得华中理工大学生物技术专业硕士学位, 2002 年获得中欧国际工商学院工商管理专业硕士学位。2002 年 11 月至 2004 年 4 月在上海融昌资产管理有限公司先后担任行业研究员、研究总监助理; 2004 年 5 月至 2006 年 5 月在广州金骏资产管理有限公司先后担任研究副总监、研究总监; 2006 年 6 月至 2010 年 4 月在诺德基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理、投资研究部经理、基金经理; 2010 年 5 月加入光大保德信基金管理有限公司, 先后担任研究副总监、研究总监。现任权益投资部总监、光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金经理、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金基金经理、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、光大保德信红利混合型证券投资基金基金经理。

陆海燕	基金经理	2016-04-26	-	5 年	陆海燕女士，硕士，2006 年获得东南大学金融学学士学位，2011 年获得东南大学金融学硕士学位。
-----	------	------------	---	-----	---

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

回顾上个季度的季报，我们认为，同过去两年相比，A 股市场在 2016 年里有两个最为重要的变化。一是从大类资产收益率均值回归的角度看待问题将成为影响证券市场的主要矛盾，另一个变化则是证券市场对经济增长的预期差有可能成为影响证券市场的主要矛盾。尽管本轮行情始自 2012 年底，成长和转型是贯穿整个朱格拉周期下行阶段的投资主线。但是，在无风险收益率持续下行之后，在杠杆资金入市受限之后，企业盈利的边际变动将重新成为证券市场盈利的重要来源。金融资产的收益率终将受到实体经济投资回报率的约束。

基于上述判断，从策略上来看，本基金一方面将继续坚持自下而上精选个股，中期内持续看好结构调整和消费升级所带来的消费类行业的增长机会；另一方面，也将更加关注宏观经济边际变动

对资产配置的影响，更加关注企业资产负债表的健康状况，更加注重企业估值水平同当前盈利水平之间的合理关系。从实际情况来看，在今年第二季度窄幅震荡的市场环境中，上述策略使得本基金在较为有效的控制住下方偏离波动率的同时保持了相当的进攻性。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为-11.61%，业绩比较基准收益率为-11.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，这一轮发端于 2008 年的全球经济危机行程过半，本轮库存周期的尾部风险在去年夏天得到很大程度的释放。不过，以英国“脱欧”为标志，本轮危机进入了一个新阶段，包括英国“脱欧”以及美国大选过程中新孤立主义的隐现，表明作为全球化发源地的欧美发达经济体内部对全球化的抵触和拒斥可能更具破坏性。同时，全球飙升至几十万亿美元的负收益债券和零收益率债券反映出全球经济金融体系的脆弱性和体系面临重构的必要性，体系很可能面临着二战以来最严峻的挑战。对于中国经济而言，经过长达八年的“下台阶”，我们预计中国经济的实际增速在新常态的格局下大体实现了软着陆。在经济“L 型”的整体格局下，尽管依然会有波折和反复，但对经济增速不断的线性外推显然是一种平面思维模式。随着积极财政政策效应的逐步释放，包括地方政府债务置换的大面积实施，今年下半年财政政策有望继续发力，中国经济在 2016 年实现 6.5%--7% 的增长依然值得期待。就 A 股市场而言，在无风险收益率持续下行之后，在杠杆资金入市受限之后，企业盈利的边际变动将重新成为证券市场盈利的重要来源。金融资产的收益率终将受到实体经济投资回报率约束，从大类资产收益率均值回归的角度看待问题将成为影响证券市场的主要矛盾，证券市场对经济增长的预期差则有可能成为影响证券市场的主要矛盾。此外全球化进入新阶段以及全球经济金融体系的不稳定性对 A 股市场也将产生各种机会和风险。

基于上述判断，从策略上来看，本基金一方面将继续坚持自下而上精选个股，中期内持续看好结构调整和消费升级所带来的消费类行业的成长机会；另一方面，也将更加关注宏观经济边际变动对资产配置的影响，更加注重企业估值水平同当前盈利水平之间的合理关系，更加关注企业资产负债表的健康状况，更加关注全球化进入新阶段所蕴涵的机会和风险。展望新的一年，本基金管理人将通过上述策略力争帮助基金的长期持有人在岁月中感受时间玫瑰的清香，为持有人创造长期持基的“复利魅力”。

#### 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，本基金本报告期内进行一次利润分配。2016 年 4 月 15 日本基金份额每 10 份派发红利 12.50 元。

#### **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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金实施利润分配的金额为 753,655,313.55 元。

### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，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：光大保德信红利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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	242,818,245.31	240,047,989.27
结算备付金		8,173,216.55	6,635,215.40
存出保证金		1,606,826.70	1,879,545.95
交易性金融资产	6.4.7.2	1,389,072,206.02	2,035,670,579.54
其中：股票投资		1,389,072,206.02	2,035,670,579.54
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	100,000,250.00	120,000,000.00
应收证券清算款		10,336,380.46	-
应收利息	6.4.7.5	184,288.01	126,165.41
应收股利		-	-
应收申购款		13,167,509.93	50,610,151.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,765,358,922.98</b>	<b>2,454,969,647.32</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		-	-
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		18,869,097.12	123,968,002.61
应付赎回款		49,573,387.80	1,374,269.95
应付管理人报酬		2,057,940.07	2,910,115.83
应付托管费		342,990.02	485,019.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,657,937.48	2,078,546.21
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	381,557.32	401,695.63
<b>负债合计</b>		<b>74,882,909.81</b>	<b>131,217,649.54</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	589,830,046.53	495,885,806.83
未分配利润	6.4.7.10	1,100,645,966.64	1,827,866,190.95
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,690,476,013.17</b>	<b>2,323,751,997.78</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,765,358,922.98</b>	<b>2,454,969,647.32</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.8660 元，基金份额总额 589,830,046.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信红利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	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-253,832,163.10</b>	<b>1,054,317,650.73</b>
1.利息收入		3,127,430.14	1,885,522.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,039,347.72	1,468,644.98
债券利息收入		2,225.78	281,023.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		85,856.64	135,854.08
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-257,063,112.61	1,318,124,849.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-263,999,999.10	1,315,612,746.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	263,858.85	-9,722,442.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,673,027.64	12,234,545.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-738,080.50	-266,651,239.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	841,599.87	958,518.30
<b>减：二、费用</b>		<b>27,176,218.83</b>	<b>35,725,679.54</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	15,087,722.71	18,297,509.58
2. 托管费	6.4.10.2	2,514,620.40	3,049,584.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	9,353,376.58	14,161,042.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	220,499.14	217,542.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-281,008,381.93</b>	<b>1,018,591,971.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-281,008,381.93</b>	<b>1,018,591,971.19</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信红利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	495,885,806.83	1,827,866,190.95	2,323,751,997.78

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-281,008,381.93	-281,008,381.93
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)	93,944,239.70	307,443,471.17	401,387,710.87
其中: 1.基金申购款	372,487,877.23	967,298,546.05	1,339,786,423.28
2.基金赎回款	-278,543,637.53	-659,855,074.88	-938,398,712.41
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)	-	-753,655,313.55	-753,655,313.55
五、期末所有者权益(基金净值)	589,830,046.53	1,100,645,966.64	1,690,476,013.17
项目	上年度可比期间 2015年1月1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)	817,773,567.81	1,702,579,815.46	2,520,353,383.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,018,591,971.19	1,018,591,971.19
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)	-383,015,661.19	-1,167,321,935.95	-1,550,337,597.14
其中: 1.基金申购款	138,064,766.07	445,995,146.49	584,059,912.56
2.基金赎回款	-521,080,427.26	-1,613,317,082.44	-2,134,397,509.70
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)	434,757,906.62	1,553,849,850.70	1,988,607,757.32

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

光大保德信红利混合型证券投资基金(原名光大保德信红利股票型证券投资基金，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”)证监基金字[2005]206 号文《关于同意光大保德信红利股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由光大保德信基金管理有限公司作为管理人向社会公开募集，基金合同于 2006 年 3 月 24 日生效，首次设立募集规模为 532,471,074.61 份基金份额。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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金为混合型基金，通过对高分红类股票及其他具有投资价值的股票投资进行投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。本基金股票资产占基金净资产不少于 60%，最高可达基金净资产 90%，其余资产除应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券外，还可投资于中国证监会认可的其他金融工具，包括债券、可转债、央行票据、回购、权证等。

本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{上证红利指数} + 20\% \times \text{中证全债指数} + 5\% \times \text{银行活期存款利率}$ 。

#### 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 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 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的说明

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。

#### 6.4.5 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

### 6.4.6.1 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、国家税务总局财税字[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》的规定，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。

### 6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，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、国家税务总局财税字[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》的规定，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》的规定，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。

### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，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、国家税务总局财税字[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》的规定，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、国家税务总局财税字[2008]132 号文《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》的规定，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；

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》的规定，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。

## 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	242,818,245.31
定期存款	-
其他存款	-
合计	242,818,245.31

### 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	1,276,463,528.75	1,389,072,206.02	112,608,677.27
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	1,276,463,528.75	1,389,072,206.02	112,608,677.27

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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	100,000,250.00	-
合计	100,000,250.00	-

**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	144,405.35
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	3,310.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	6,599.32
应收申购款利息	29,322.35
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	650.79
合计	184,288.01

**6.4.7.6 其他资产**

本基金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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,657,409.11
银行间市场应付交易费用	528.37
合计	3,657,937.48

**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	182,133.85
其他	-
应付银行划款手续费	-
应付转出费	519.31
预提费用	198,904.16
合计	381,557.32

#### 6.4.7.9 实收基金

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（份）	账面金额
上年度末	495,885,806.83	495,885,806.83
本期申购	372,487,877.23	372,487,877.23
本期赎回（以“-”号填列）	-278,543,637.53	-278,543,637.53
本期末	589,830,046.53	589,830,046.53

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	1,154,037,718.84	673,828,472.11	1,827,866,190.95
本期利润	-280,270,301.43	-738,080.50	-281,008,381.93
本期基金份额交易产生的变动数	257,100,353.32	50,343,117.85	307,443,471.17
其中：基金申购款	667,797,015.29	299,501,530.76	967,298,546.05
基金赎回款	-410,696,661.97	-249,158,412.91	-659,855,074.88
本期已分配利润	-753,655,313.55	-	-753,655,313.55
本期末	377,212,457.18	723,433,509.46	1,100,645,966.64

#### 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	2,952,025.67
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	46,612.16

其他	40,709.89
合计	3,039,347.72

#### 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	3,254,202,715.84
减：卖出股票成本总额	3,518,202,714.94
买卖股票差价收入	-263,999,999.10

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 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	263,858.85
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	263,858.85

##### 6.4.7.13.2 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	6,946,320.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,676,307.71
减：应收利息总额	6,153.63
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	263,858.85

#### 6.4.7.14 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。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

#### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

### 6.4.7.17 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	6,673,027.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,673,027.64

### 6.4.7.18 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	-738,080.50
——股票投资	-738,080.50
——债券投资	-
——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	-738,080.50

### 6.4.7.19 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	801,464.52
转换费	40,135.35
合计	841,599.87

### 6.4.7.20 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	9,353,355.13
银行间市场交易费用	21.45
合计	9,353,376.58

#### 6.4.7.21 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
账户维护费	19,500.00
其他费用	2,094.98
合计	220,499.14

#### 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未发生变化。

##### 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
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
兴业银行股份有限公司(简称"兴业银行")	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：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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1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	152,621,792.24	2.49%	869,633,465.33	9.52%

### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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1月1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	-	-	148,961,641.50	22.75%

### 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1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	-	-	943,400,000.00	59.92%

### 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	142,136.02	2.56%	142,136.02	3.89%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1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	791,712.18	10.10%	257,925.50	5.66%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除由证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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1月1日至2015年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,087,722.71	18,297,509.58
其中：支付销售机构的客户维护费	1,145,959.58	2,433,082.37

注：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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

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1月1日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,514,620.40	3,049,584.97

注：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，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1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
兴业银行	242,818,245.31	2,952,025.67	293,261,476.89	1,378,010.85

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本期卖出兴业银行股份有限公司股票 4,000,000 股。本期末未持有兴业银行股份有限公司股票。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注

		场内	场外	基金份额数				
1	2016-04-15	-	2016-04-15	12.500	506,651,540.90	247,003,772.65	753,655,313.55	-
合计				12.500	506,651,540.90	247,003,772.65	753,655,313.55	-

#### 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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-

##### 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
000718	苏宁环球	2016-01-04	重大事项停牌	13.09	2016-07-18	11.78	1,300	20,616.10	17,017.00	-
002447	壹桥海参	2016-03-09	重大资产重组	7.19	-	-	1,000	9,404.01	7,190.00	-
600497	驰宏锌锗	2016-06-13	非公开发行股票	9.97	2016-07-11	10.97	3,508,616	36,483,830.35	34,980,901.52	-
600511	国药股份	2016-02-18	重大资产重组	27.44	2016-08-04	30.16	100	2,656.19	2,744.00	-

##### 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, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 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等级的证券, 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，在保护基金份额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	242,818,245.31	-	-	-	-	-	242,818,245.31
结算备付金	8,173,216.55	-	-	-	-	-	8,173,216.55
存出保证金	1,606,826.70	-	-	-	-	-	1,606,826.70
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	1,389,072,206.02	1,389,072,206.02
买入返售金 融资产	100,000,250.00	-	-	-	-	-	100,000,250.00
应收利息	-	-	-	-	-	184,288.01	184,288.01
应收申购款	11,999,498.50	-	-	-	-	1,168,011.43	13,167,509.93
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	10,336,380.46	10,336,380.46
资产总计	364,598,037.06	-	-	-	-	1,400,760,885.92	1,765,358,922.98
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	18,869,097.12	18,869,097.12
应付赎回款	-	-	-	-	-	49,573,387.80	49,573,387.80
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	2,057,940.07	2,057,940.07
应付托管费	-	-	-	-	-	342,990.02	342,990.02
应付交易费 用	-	-	-	-	-	3,657,937.48	3,657,937.48
其他负债	-	-	-	-	-	381,557.32	381,557.32
负债总计	-	-	-	-	-	74,882,909.81	74,882,909.81
利率敏感度 缺口	364,598,037.06	-	-	-	-	1,325,877,976.11	1,690,476,013.17
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	240,047,989.27	-	-	-	-	-	240,047,989.27
结算备付金	6,635,215.40	-	-	-	-	-	6,635,215.40
存出保证金	1,879,545.95	-	-	-	-	-	1,879,545.95
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	2,035,670,579.54	2,035,670,579.54
买入返售金	120,000,000.00	-	-	-	-	-	120,000,000.00

融资产							
应收利息	-	-	-	-	-	126,165.41	126,165.41
应收申购款	49,999,000.00	-	-	-	-	611,151.75	50,610,151.75
资产总计	418,561,750.62	-	-	-	-	2,036,407,896.70	2,454,969,647.32
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	123,968,002.61	123,968,002.61
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,374,269.95	1,374,269.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,910,115.83	2,910,115.83
应付托管费	-	-	-	-	-	485,019.31	485,019.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,078,546.21	2,078,546.21
其他负债	-	-	-	-	-	401,695.63	401,695.63
负债总计	-	-	-	-	-	131,217,649.54	131,217,649.54
利率敏感度缺口	418,561,750.62	-	-	-	-	1,905,190,247.16	2,323,751,997.78

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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%	-	-
	基准利率下降 1%	-	-

注：本基金本期末未持有债券，因此无重大利率风险。

#### 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

本基金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	1,389,072,206.02	82.17	2,035,670,579.54	87.60
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	1,389,072,206.02	82.17	2,035,670,579.54	87.60

#### 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 2,397	增加约 2,430
	业绩比较基准下降 1%	减少约 2,397	减少约 2,430

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。

#### 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	1,389,072,206.02	78.68
	其中：股票	1,389,072,206.02	78.68
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	100,000,250.00	5.66
	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	250,991,461.86	14.22
7	其他各项资产	25,295,005.10	1.43
8	合计	1,765,358,922.98	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	54,999,594.30	3.25
B	采矿业	146,071,791.95	8.64
C	制造业	883,434,969.07	52.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	75,102,550.42	4.44
E	建筑业	4,186,080.00	0.25
F	批发和零售业	2,744.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	15,036,199.14	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,510,102.94	1.15
J	金融业	-	-

K	房地产业	2,988,277.00	0.18
L	租赁和商务服务业	55,569,572.62	3.29
M	科学研究和技术服务业	58,181,366.10	3.44
N	水利、环境和公共设施管理业	40,224,118.00	2.38
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	33,764,840.48	2.00
S	综合	-	-
	合计	1,389,072,206.02	82.17

### 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	600547	山东黄金	2,855,073	111,090,890.43	6.57
2	600519	贵州茅台	339,918	99,228,862.56	5.87
3	300012	华测检测	4,698,000	58,161,240.00	3.44
4	300058	蓝色光标	5,722,922	55,569,572.62	3.29
5	000858	五粮液	1,476,804	48,040,434.12	2.84
6	300146	汤臣倍健	3,453,386	46,758,846.44	2.77
7	002299	圣农发展	1,769,977	45,842,404.30	2.71
8	600497	驰宏锌锗	3,508,616	34,980,901.52	2.07
9	002179	中航光电	779,869	33,783,925.08	2.00
10	300026	红日药业	1,800,348	31,308,051.72	1.85
11	600056	中国医药	1,439,401	22,828,899.86	1.35
12	002001	新和成	1,031,600	21,797,708.00	1.29
13	600557	康缘药业	1,173,740	19,167,174.20	1.13
14	000650	仁和药业	2,153,000	17,568,480.00	1.04
15	300230	永利股份	572,115	16,637,104.20	0.98
16	002003	伟星股份	1,015,800	15,876,954.00	0.94
17	300258	精锻科技	959,406	15,504,000.96	0.92
18	002185	华天科技	1,197,040	15,238,319.20	0.90
19	603766	隆鑫通用	752,230	15,210,090.60	0.90
20	300319	麦捷科技	508,496	14,654,854.72	0.87
21	600273	嘉化能源	1,608,600	14,332,626.00	0.85
22	600312	平高电气	912,700	14,292,882.00	0.85
23	601012	隆基股份	1,089,400	14,216,670.00	0.84
24	000915	山大华特	399,280	14,122,533.60	0.84

25	000418	小天鹅 A	429,645	14,015,019.90	0.83
26	002050	三花股份	1,441,806	13,913,427.90	0.82
27	000400	许继电气	901,100	13,912,984.00	0.82
28	600323	瀚蓝环境	1,075,000	13,641,750.00	0.81
29	000012	南玻 A	1,184,700	13,576,662.00	0.80
30	002238	天威视讯	928,030	13,428,594.10	0.79
31	300255	常山药业	1,609,952	13,362,601.60	0.79
32	002470	金正大	1,653,671	13,312,051.55	0.79
33	600529	山东药玻	751,567	13,235,094.87	0.78
34	601139	深圳燃气	1,648,282	13,186,256.00	0.78
35	600537	亿晶光电	1,709,600	13,181,016.00	0.78
36	600872	中炬高新	1,067,890	13,177,762.60	0.78
37	002411	必康股份	722,300	12,893,055.00	0.76
38	000888	峨眉山 A	1,068,435	12,863,957.40	0.76
39	600350	山东高速	2,422,991	12,841,852.30	0.76
40	000719	大地传媒	1,204,324	12,717,661.44	0.75
41	600216	浙江医药	960,400	12,667,676.00	0.75
42	601801	皖新传媒	1,084,630	12,657,632.10	0.75
43	600809	山西汾酒	566,584	12,566,833.12	0.74
44	600505	西昌电力	1,395,214	12,445,308.88	0.74
45	000430	张家界	1,092,302	12,397,627.70	0.73
46	002444	巨星科技	609,900	12,393,168.00	0.73
47	600987	航民股份	1,020,700	12,370,884.00	0.73
48	600635	大众公用	2,033,950	12,264,718.50	0.73
49	002557	洽洽食品	653,000	12,171,920.00	0.72
50	002292	奥飞娱乐	398,502	11,935,134.90	0.71
51	601199	江南水务	1,523,118	11,849,858.04	0.70
52	600054	黄山旅游	735,635	11,836,367.15	0.70
53	002100	天康生物	1,303,400	11,717,566.00	0.69
54	000869	张裕 A	289,506	11,632,351.08	0.69
55	002603	以岭药业	704,100	11,202,231.00	0.66
56	002481	双塔食品	1,520,350	11,098,555.00	0.66
57	600176	中国巨石	1,153,020	11,034,401.40	0.65
58	002756	永兴特钢	415,260	9,476,233.20	0.56
59	603889	新澳股份	653,289	9,459,624.72	0.56
60	600975	新五丰	1,000,000	9,150,000.00	0.54
61	002267	陕天然气	800,000	8,400,000.00	0.50
62	600757	长江传媒	999,946	8,389,546.94	0.50
63	002124	天邦股份	760,046	8,094,489.90	0.48
64	002472	双环传动	280,700	6,826,624.00	0.40
65	300147	香雪制药	440,974	6,495,547.02	0.38
66	002332	仙琚制药	575,725	6,448,120.00	0.38
67	603010	万盛股份	288,502	6,381,664.24	0.38
68	300271	华宇软件	317,707	6,011,016.44	0.36

69	600597	光明乳业	464,861	5,894,437.48	0.35
70	000738	中航动控	209,297	5,525,440.80	0.33
71	002508	老板电器	148,800	5,471,376.00	0.32
72	002507	涪陵榨菜	434,969	5,237,026.76	0.31
73	300124	汇川技术	253,600	4,919,840.00	0.29
74	603030	全筑股份	153,000	4,186,080.00	0.25
75	000596	古井贡酒	86,707	4,157,600.65	0.25
76	000568	泸州老窖	135,800	4,033,260.00	0.24
77	600487	亨通光电	300,000	3,774,000.00	0.22
78	600388	龙净环保	300,000	3,768,000.00	0.22
79	002372	伟星新材	260,910	3,746,667.60	0.22
80	600651	飞乐音响	294,800	3,732,168.00	0.22
81	600702	沱牌舍得	144,000	3,634,560.00	0.22
82	600562	国睿科技	100,800	3,456,432.00	0.20
83	002543	万和电气	185,300	3,426,197.00	0.20
84	300190	维尔利	179,975	3,126,165.75	0.18
85	002208	合肥城建	153,000	2,971,260.00	0.18
86	600584	长电科技	145,598	2,954,183.42	0.17
87	002413	雷科防务	205,300	2,818,769.00	0.17
88	600029	南方航空	310,814	2,194,346.84	0.13
89	600452	涪陵电力	65,400	2,185,014.00	0.13
90	601689	拓普集团	52,400	1,726,580.00	0.10
91	002454	松芝股份	83,700	1,521,666.00	0.09
92	600198	大唐电信	66,600	1,324,008.00	0.08
93	000601	韶能股份	108,100	1,129,645.00	0.07
94	002366	台海核电	19,300	1,028,883.00	0.06
95	300115	长盈精密	49,800	1,025,880.00	0.06
96	002463	沪电股份	117,000	617,760.00	0.04
97	300266	兴源环境	5,500	230,120.00	0.01
98	300232	洲明科技	13,300	210,805.00	0.01
99	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
100	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
101	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
102	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
103	000718	苏宁环球	1,300	17,017.00	0.00
104	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
105	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
106	002447	壹桥海参	1,000	7,190.00	0.00
107	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
108	600511	国药股份	100	2,744.00	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	000333	美的集团	113,390,550.77	4.88
2	300133	华策影视	107,849,516.18	4.64
3	600519	贵州茅台	102,486,097.07	4.41
4	600547	山东黄金	96,082,969.78	4.13
5	300058	蓝色光标	72,839,898.45	3.13
6	300012	华测检测	61,503,903.17	2.65
7	600837	海通证券	51,020,631.15	2.20
8	300146	汤臣倍健	50,075,419.80	2.15
9	002236	大华股份	44,430,760.98	1.91
10	600497	驰宏锌锗	42,921,451.16	1.85
11	600585	海螺水泥	40,990,819.00	1.76
12	601169	北京银行	36,199,339.80	1.56
13	002299	圣农发展	35,233,160.76	1.52
14	002475	立讯精密	35,019,993.83	1.51
15	600114	东睦股份	30,557,123.92	1.31
16	600872	中炬高新	29,593,943.84	1.27
17	600867	通化东宝	29,313,399.86	1.26
18	600305	恒顺醋业	28,654,414.20	1.23
19	300026	红日药业	28,151,083.62	1.21
20	002241	歌尔股份	27,007,847.03	1.16

## 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	002400	省广股份	154,376,287.40	6.64
2	300133	华策影视	147,911,306.68	6.37
3	002236	大华股份	139,803,631.73	6.02
4	000333	美的集团	124,875,867.15	5.37
5	601688	华泰证券	118,506,691.57	5.10
6	601169	北京银行	117,186,229.64	5.04
7	002475	立讯精密	93,011,615.21	4.00
8	600867	通化东宝	71,119,334.45	3.06
9	600521	华海药业	61,728,680.70	2.66
10	601166	兴业银行	61,677,051.60	2.65
11	600837	海通证券	58,778,284.15	2.53
12	601318	中国平安	50,554,876.24	2.18
13	300196	长海股份	50,178,359.48	2.16

14	300012	华测检测	49,597,406.39	2.13
15	000858	五粮液	47,694,193.05	2.05
16	002308	威创股份	46,746,744.82	2.01
17	300295	三六五网	44,811,087.21	1.93
18	000681	视觉中国	42,305,545.94	1.82
19	600585	海螺水泥	41,933,663.23	1.80
20	600305	恒顺醋业	40,468,938.95	1.74

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,872,342,421.92
卖出股票的收入（成交）总额	3,254,202,715.84

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末本基金未投资债券。

#### 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

报告期末本基金未投资债券。

#### 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

报告期末本基金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

报告期末本基金未投资贵金属。

#### 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

报告期末本基金未投资权证。

#### 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

报告期末本基金未投资股指期货交易。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以

套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未投资国债期货交易。

## 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 本报告期内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。

### 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	1,606,826.70
2	应收证券清算款	10,336,380.46
3	应收股利	-
4	应收利息	184,288.01
5	应收申购款	13,167,509.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,295,005.10

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

报告期末本基金未投资可转换债券。

**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	600497	驰宏锌锗	34,980,901.52	2.07	筹划非公开发 行股票

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

报告期内本基金没有其他需要说明的重要事项。

**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
29,592	19,932.08	285,259,507.73	48.36%	304,570,538.80	51.64%

**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	235,824.35	0.04%

**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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 3 月 24 日）基金份额总额	532,471,074.61
本报告期期初基金份额总额	495,885,806.83
本报告期基金总申购份额	372,487,877.23
减：本报告期基金总赎回份额	278,543,637.53
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	589,830,046.53

## 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	
财富证券	1	11,881,463.73	0.19%	11,065.20	0.20%	-
平安证券	1	81,562,340.69	1.33%	74,327.81	1.34%	-
东方证券	1	147,257,886.35	2.40%	134,196.09	2.42%	-
光大证券	1	152,621,792.24	2.49%	142,136.02	2.56%	-
民生证券	1	334,980,597.12	5.47%	238,271.78	4.29%	-
申银万国	1	355,179,103.17	5.80%	330,777.87	5.95%	-
信达证券	1	578,861,949.75	9.45%	527,517.61	9.50%	-
中信建投	1	621,039,667.81	10.14%	578,372.96	10.41%	-
国金证券	1	754,712,994.06	12.32%	687,770.23	12.38%	-
国信证券	1	860,977,804.23	14.06%	801,829.38	14.43%	-
中银国际	1	1,080,933,875.71	17.65%	985,055.74	17.73%	-
华创证券	2	1,145,503,169.89	18.70%	1,043,898.11	18.79%	-

注：本报告期内本基金新增租用信达证券交易单元。

本报告期内本基金未撤销租用证券交易单元。

专用交易单元的选择标准和程序

(1) 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。

(2) 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，并报本管理人董事会批准。

□ 经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

### 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
财富证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	340,000,000.00	47.82%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	371,000,000.00	52.18%	-	-
中银国际	6,946,320.19	50.98%	-	-	-	-
华创证券	6,680,235.56	49.02%	-	-	-	-

### 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	《中国证券报》、《上海证	2016-01-04

	年 12 月 31 日资产净值公告	券报》、《证券时报》	
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	光大保德信红利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	光大保德信红利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
6	光大保德信红利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
7	关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-01
8	光大保德信红利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》	2016-04-02
9	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
10	光大保德信红利混合型证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-12
11	光大保德信红利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
12	光大保德信红利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》	2016-04-26
13	光大保德信红利混合型证券投资基金招募说明书(更新)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-07
14	光大保德信红利混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-07
15	有关旗下部分基金参加中国民生银行直销银行“基金通”平台费用优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-14
16	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动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-27
17	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在平安证券开通定期定额投资及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-14
18	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
19	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

20	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 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

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

### 12.2 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。

### 12.3 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。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