

**光大保德信优势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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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.....	9
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.....	10
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	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.....	45
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.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47

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
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>47</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	51
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>52</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信优势配置混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信优势配置混合
基金主代码	360007
交易代码	360007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,455,828,049.81 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求投资回报的实现，在严格管理风险的基础上，根据证券市场的变化进行行业配置，通过科学投资争取为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金为追求绝对收益的基金，强调在敏锐把握证券市场和中国经济变化方向的基础上，适当配置资产在各类证券和行业之间的比重，通过收益管理和稳健的投资操作作为基金份额持有人谋取超过业绩比较基准的稳定回报。在行业配置方面，本基金将主要投资于国家重点支柱型产业。在个股选择上，本基金将主要投资于目标行业内按总市值排名前三分之一的大盘绩优股。
业绩比较基准	75% × 沪深 300 指数 + 25% × 中证全债指数
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	张燕
	联系电话	021-80262888-605	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95555
传真		021-80262468	0755-83195201
注册地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558	深圳市深南大道7088号招商银

	号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层	行大厦
邮政编码	200002	518040
法定代表人	林昌	李建红

## 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、招商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	-431,618,990.67
本期利润	-665,484,939.35
加权平均基金份额本期利润	-0.2369
本期加权平均净值利润率	-19.96%
本期基金份额净值增长率	-13.04%
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	510,271,229.98
期末可供分配基金份额利润	0.2078
期末基金资产净值	2,966,099,279.79
期末基金份额净值	1.2078
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	28.40%

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	4.37%	1.27%	-0.17%	0.74%	4.54%	0.53%
过去三个月	3.11%	1.35%	-1.35%	0.76%	4.46%	0.59%
过去六个月	-13.04%	2.07%	-11.14%	1.38%	-1.90%	0.69%
过去一年	-9.30%	2.20%	-20.73%	1.73%	11.43%	0.47%
过去三年	99.16%	1.73%	41.39%	1.38%	57.77%	0.35%
自基金合同生效起至今	28.40%	1.64%	-17.26%	1.43%	45.66%	0.21%

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，经与基金托管人招商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%×沪深 300 指数+25%×天相国债全价指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数”。

#### 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

光大保德信优势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  
 （2007 年 8 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，经与基金托管人招商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%×沪深 300 指数+25%×天相国债全价指数”变更为“75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2007 年 8 月 24 日至 2008 年 2 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		
何奇	基金经理	2015-08-03	-	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

本基金在一季度操作中，一月初在资产配置层面适当降低了股票仓位，行业配置方面加大了对银行、家电等蓝筹股的配置比例；一季度中期在资产配置层面适度增加了股票仓位，行业配置方面逐步买入了部分超跌传媒和计算机等行业的成长股；一季度后期在资产配置层面维持了相对稳定的股票仓位，行业配置方面适度加大了对白酒、环保等行业的配置比例，并减持了部分估值偏高的转型股。在二季度操作中，四月初在资产配置层面适当降低了股票仓位，行业配置方面降低了对传媒、计算机等 TMT 成长股的配置比例；二季度中期在资产配置层面适度增加了股票仓位，行业配置方面逐步加配了部分养殖和汽车个股；二季度后期在资产配置层面略微降低了股票仓位，行业配置方面适度加大了对机械、环保等行业的配置比例，并进一步减持了部分估值偏高的成长股。本基金在个股选择上始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平，对于转型相关个股尤其注重精挑细选。

#### 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-13.04%，业绩比较基准收益率为-11.14%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经历过年初的估值杀跌之后，二季度市场整体处于弱势震荡格局，但在新能源汽车、白酒和无人驾驶等板块呈现出了明显的结构性行情。展望下半年，我们认为有三大因素可能成为影响市场的重要边际力量：

首先，经济增速下滑存在超预期的可能。我们维持一季报的判断，认为今年三季度以后房地产行业可能进入长达半年以上的下行周期，并且若无明显的政策对冲，本轮下行的最大幅度可能超过 2014 年。虽然基建是对冲房地产下行的最可行因素，但是考虑到上半年基建投资增速处于近几年均值附近，我们倾向于认为下半年基建投资的发力无法完全对冲掉房地产下行的负面影响。考虑到当前全球政治经济环境动荡，而三季度国内洪涝等自然灾害较多，我们认为经济增速存在超预期下滑的可能性。

其次，通胀预期可能存在变数。考虑到下半年国内房价和猪肉价格涨幅收窄的概率很大，通胀存在着下行的可能性。但是由于英国脱欧等黑天鹅事件影响，全球主要经济体不排除被动加码宽松，而国内自然灾害是否会加剧食品价格上涨也存在不确定性，所以下半年通胀下行预期可能被干扰，这为相关产业链投资带来机会，也对无风险利率产生影响。我们必须密切关注全球形势及国内自然灾害情况，并在干扰信号出现后做出反应。

最后，风险偏好可能一波三折。继汇率波动、经济下滑、英国脱欧等因素陆续出现后，下半年市场依然存在着不少改变风险偏好的事件：一方面，全球经济增长乏力可能进一步催生类似英国脱欧的黑天鹅事件；另一方面，国企改革和洪涝灾害等国内各种因素也可能在某个时点发酵。因此，下半年市场风险偏好可能一波三折，市场择时的空间依然存在。

综上所述，下半年影响市场的诸多变量存在着较大的不确定性，并且尚不能观测到市场合力出现趋势性行情的迹象。站在当前时点，我们依然维持弱势震荡的判断，并密切关注上述三方面因素可能带来的边际影响。

基于以上判断，下半年我们主要采取三种策略应对：一是关注 PEG 在 1 倍附近的相对低知名度成长股，并重点布局业绩确定性高且有催化剂的个股；二是关注新能源汽车、无人驾驶、有色和供给侧改革等主题，并波段性布局有竞争力的优质龙头公司；三是小仓位审慎参与市场择时。

尽管我们在中长期坚定看好中国资本市场和新兴行业的发展，并认为很多优质公司的估值已经跌入合理区间，但是不可否认的是，今年 A 股的结构性的机会必须兼顾择时和选股。展望未来，我们将从容和果断的应对市场波动，并笃信坚守具有核心竞争力的优势企业，为持有人创造长期可持续的投资收益。

#### 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，本基金本报告期内进行一次利润分配。2016 年 4 月 11 日本基金份额每 10 份派发红利 0.75 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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。

报告期内，2016 年 4 月 11 日本基金份额实施利润分配的金额为 186,551,000.82 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：光大保德信优势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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	329,712,430.30	566,893,289.15
结算备付金		11,063,881.58	21,878,849.90
存出保证金		2,479,953.59	3,899,174.26
交易性金融资产	6.4.7.2	2,246,852,530.40	4,099,192,419.65
其中：股票投资		2,246,852,530.40	4,096,310,319.65
基金投资		-	-
债券投资		-	2,882,100.00
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	200,000,000.00	320,000,000.00
应收证券清算款		245,683,432.08	-
应收利息	6.4.7.5	97,389.32	132,248.79
应收股利		-	-
应收申购款		67,252.45	338,441.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,035,956,869.72</b>	<b>5,012,334,423.46</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		52,688,464.66	317,219,645.10
应付赎回款		4,671,016.59	8,521,118.21
应付管理人报酬		3,558,437.71	5,778,527.75
应付托管费		593,072.97	963,087.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,140,325.87	9,485,703.61
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	206,272.13	402,497.82
<b>负债合计</b>		<b>69,857,589.93</b>	<b>342,370,580.44</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,455,828,049.81	3,162,587,338.22
未分配利润	6.4.7.10	510,271,229.98	1,507,376,504.80
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,966,099,279.79</b>	<b>4,669,963,843.02</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,035,956,869.72</b>	<b>5,012,334,423.46</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2078 元，基金份额总额 2,455,828,049.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：光大保德信优势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	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>-614,552,227.03</b>	<b>3,379,824,497.83</b>
1.利息收入		3,331,409.94	4,536,921.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,043,935.18	2,187,688.37
债券利息收入		600.10	749,915.38
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,286,874.66	1,599,317.69
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-385,092,373.89	3,889,114,841.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-396,025,565.86	3,841,196,034.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	354,261.89	9,223,871.07
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	10,578,930.08	38,694,935.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-233,865,948.68	-514,482,499.48
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	1,074,685.60	655,234.58
<b>减：二、费用</b>		<b>50,932,712.32</b>	<b>96,274,653.75</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	25,032,225.40	59,662,570.62
2. 托管费	6.4.10.2	4,172,037.58	9,943,761.81
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	21,495,791.94	26,424,222.15
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	232,657.40	244,099.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-665,484,939.35</b>	<b>3,283,549,844.08</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-665,484,939.35</b>	<b>3,283,549,844.08</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信优势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	3,162,587,338.22	1,507,376,504.80	4,669,963,843.02

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-665,484,939.35	-665,484,939.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-706,759,288.41	-145,069,334.65	-851,828,623.06
其中: 1.基金申购款	373,542,202.60	61,030,519.76	434,572,722.36
2.基金赎回款	-1,080,301,491.01	-206,099,854.41	-1,286,401,345.42
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)	-	-186,551,000.82	-186,551,000.82
五、期末所有者权益(基金净值)	2,455,828,049.81	510,271,229.98	2,966,099,279.79
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)	9,435,300,031.60	-123,320,709.63	9,311,979,321.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,283,549,844.08	3,283,549,844.08
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)	-5,823,694,732.72	-1,658,764,207.75	-7,482,458,940.47
其中: 1.基金申购款	332,117,976.42	102,734,767.86	434,852,744.28
2.基金赎回款	-6,155,812,709.14	-1,761,498,975.61	-7,917,311,684.75
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)	3,611,605,298.88	1,501,464,926.70	5,113,070,225.58

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

光大保德信优势配置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[2007]223 号文《关于同意光大保德信优势配置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发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2007 年 8 月 24 日正式生效，首次设立募集规模为 9,905,973,604.86 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及注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为股票型基金，投资范围包括国内依法发行、上市的股票、债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票资产占基金资产不少于 60%，最高可达基金资产的 90%，现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证不超过基金资产净值的 3%。本基金的业绩比较基准为：75%×沪深 300 指数+25%×中证全债指数。

#### 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，也参考了中国证券业协会制定的《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 06 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	329,712,430.30
定期存款	-
其他存款	-
合计	329,712,430.30

#### 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	2,021,092,487.30	2,246,852,530.40	225,760,043.10
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	2,021,092,487.30	2,246,852,530.40	225,760,043.10

#### 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
上海证券交易所市场	200,000,000.00	-
合计	200,000,000.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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	86,077.17
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	4,978.70
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	5,217.45
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,116.00
合计	97,389.32

#### 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	8,140,155.87
银行间市场应付交易费用	170.00
合计	8,140,325.87

#### 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	6,335.92
其他	-
应付银行划款手续费	-
应付转出费	1,032.05
预提费用	198,904.16
合计	206,272.13

#### 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	3,162,587,338.22	3,162,587,338.22
本期申购	373,542,202.60	373,542,202.60
本期赎回（以“-”号填列）	-1,080,301,491.01	-1,080,301,491.01
本期末	2,455,828,049.81	2,455,828,049.81

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	2,397,753,393.96	-890,376,889.16	1,507,376,504.80
本期利润	-431,618,990.67	-233,865,948.68	-665,484,939.35
本期基金份额交易产生的变动数	-452,821,503.20	307,752,168.55	-145,069,334.65
其中：基金申购款	255,194,024.18	-194,163,504.42	61,030,519.76
基金赎回款	-708,015,527.38	501,915,672.97	-206,099,854.41
本期已分配利润	-186,551,000.82	-	-186,551,000.82
本期末	1,326,761,899.27	-816,490,669.29	510,271,229.98

#### 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
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	150,742.44
其他	26,325.34
合计	2,043,935.18

### 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	7,533,820,048.49
减：卖出股票成本总额	7,929,845,614.35
买卖股票差价收入	-396,025,565.86

### 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	354,261.89
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	354,261.89

#### 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	3,237,404.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,882,100.00
减：应收利息总额	1,042.29
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	354,261.89

### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资。

### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期末进行贵金属投资。

### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期末进行衍生工具投资。

#### 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	10,578,930.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,578,930.08

#### 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	-233,865,948.68
——股票投资	-233,865,948.68
——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	-233,865,948.68

#### 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	1,072,897.66
其他收入转换费收入	1,787.94
合计	1,074,685.60

#### 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	21,495,791.94
银行间市场交易费用	-
合计	21,495,791.94

### 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
交易费用	-
账户维护费	22,500.00
其他费用	11,253.24
合计	232,657.40

### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响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
招商银行股份有限公司(简称“招商银行”)	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	-	-	175,172,344.48	1.16%

#### 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	-	-	-	-

#### 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	-	-	714,500,000.00	5.20%

#### 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	-	-	-	-

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	159,476.81	1.17%	159,476.81	1.17%

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除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	25,032,225.40	59,662,570.62
其中：支付销售机构的客户维护费	5,451,722.45	14,376,381.61

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,由基金管理人于次月首日起三个工作  
日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日  
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	4,172,037.58	9,943,761.81

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,基金管理人应于次月首日起三个工  
作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令,基金托管人复核后于当

日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

本基金本报告期以及上年度可比期间未做银行间市场债券（含回购）的关联交易。

### 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
招商银行	329,712,430.30	1,866,867.40	847,828,242.60	1,954,103.68

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 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 份基金份额分红数	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					
1	2016-04-11	-	2016-04-11	0.750	128,684,889.92	57,866,110.90	186,551,000.82	-
合计				0.750	128,684,889.92	57,866,110.90	186,551,000.82	-

## 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 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	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-

## 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
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项	14.12	-	-	293,498.00	4,444,611.09	4,144,191.76	-
002071	长城影视	2016-06-16	重大事项	13.64	-	-	102,800.00	1,471,906.90	1,402,192.00	-
002101	广东鸿图	2016-04-29	重大事项	21.62	-	-	3,700.00	77,095.00	79,994.00	-
002373	千方科技	2016-05-12	重大事项	14.94	2016-08-16	16.43	73,200.00	1,223,628.00	1,093,608.00	-
002672	东江环保	2016-05-23	重大事项	17.33	2016-07-15	19.06	74,600.00	1,306,644.87	1,292,818.00	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事项	34.99	2016-08-16	36.69	39,196.00	1,448,753.32	1,371,468.04	-
300334	津膜科技	2016-05-19	重大事项	18.05	-	-	41,200.00	692,022.11	743,660.00	-
300385	雪浪环境	2016-06-21	重大事项	35.67	2016-07-05	37.38	17,200.00	571,754.84	613,524.00	-
600121	郑州煤电	2016-06-17	重大事项	4.80	2016-07-01	5.05	120,200.00	556,186.00	576,960.00	-
600455	博通股份	2016-05-05	重大事项	49.14	-	-	3,200.00	151,862.00	157,248.00	-
600759	洲际油	2016-06-	重大事项	7.58	2016-0-	8.10	4,655,015.00	38,185,947.60	35,285,013.70	-

	气	27			7-11					
300284	苏交科	2016-05-20	重大事项	23.61	2016-08-10	21.44	74,400.00	1,467,574.88	1,756,584.00	-

### 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

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购，因此无正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购，因此无正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。本基金持有的大部门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	329,712,430.30	-	-	-	-	-	329,712,430.30
结算备付金	11,063,881.58	-	-	-	-	-	11,063,881.58
存出保证金	2,479,953.59	-	-	-	-	-	2,479,953.59
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,246,852,530.40	2,246,852,530.40
买入返售证券	200,000,000.00	-	-	-	-	-	200,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	97,389.32	97,389.32
应收申购款	-	-	-	-	-	67,252.45	67,252.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	245,683,432.08	245,683,432.08
资产总计	543,256,265.47	-	-	-	-	2,492,700,604.25	3,035,956,869.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,671,016.59	4,671,016.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,558,437.71	3,558,437.71
应付托管费	-	-	-	-	-	593,072.97	593,072.97
其他负债	-	-	-	-	-	206,272.13	206,272.13
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,140,325.87	8,140,325.87
应付证券清算款	-	-	-	-	-	52,688,464.66	52,688,464.66
负债总计	-	-	-	-	-	69,857,589.93	69,857,589.93
利率敏感度缺口	543,256,265.47	-	-	-	-	2,422,843,014.32	2,966,099,279.79
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	566,893,289.15	-	-	-	-	-	566,893,289.15
结算备付金	21,878,849.90	-	-	-	-	-	21,878,849.90
存出保证金	3,899,174.26	-	-	-	-	-	3,899,174.26
交易性金融资产	-	-	2,882,100.00	-	-	4,096,310,319.65	4,099,192,419.65
买入返售证券	320,000,000.00	-	-	-	-	-	320,000,000.00

应收利息	-	-	-	-	-	132,248.79	132,248.79
应收申购款	-	-	-	-	-	338,441.71	338,441.71
资产总计	912,671,313.31	-	2,882,100.00	-	-	4,096,781,010.15	5,012,334,423.46
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	317,219,645.10	317,219,645.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,521,118.21	8,521,118.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,778,527.75	5,778,527.75
应付托管费	-	-	-	-	-	963,087.95	963,087.95
其他负债	-	-	-	-	-	402,497.82	402,497.82
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,485,703.61	9,485,703.61
负债总计	-	-	-	-	-	342,370,580.44	342,370,580.44
利率敏感度缺口	912,671,313.31	-	2,882,100.00	-	-	3,754,410,429.71	4,669,963,843.02

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归类。

#### 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%	-	减少约17
	基准利率下降1%	-	增加约17

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	2,246,852,530.40	75.75	4,096,310,319.65	87.72
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	2,882,100.00	0.06
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	2,246,852,530.40	75.75	4,099,192,419.65	87.78

#### 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 4,169	增加约 5,016
	业绩比较基准下降 1%	减少约 4,169	减少约 5,016

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

无

### 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	2,246,852,530.40	74.01
	其中：股票	2,246,852,530.40	74.01
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	200,000,000.00	6.59
	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	340,776,311.88	11.22
7	其他各项资产	248,328,027.44	8.18
8	合计	3,035,956,869.72	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	49,492,387.70	1.67
B	采矿业	71,882,194.70	2.42
C	制造业	1,371,032,870.66	46.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,583,812.50	0.29
E	建筑业	33,471,166.12	1.13
F	批发和零售业	118,150,570.38	3.98
G	交通运输、仓储和邮政业	3,427,725.00	0.12
H	住宿和餐饮业	1,315,936.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,795,040.62	1.00
J	金融业	31,148,715.68	1.05

K	房地产业	156,539,820.80	5.28
L	租赁和商务服务业	53,125,016.72	1.79
M	科学研究和技术服务业	48,037,060.74	1.62
N	水利、环境和公共设施管理业	245,874,952.42	8.29
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	24,818,012.36	0.84
S	综合	157,248.00	0.01
	合计	2,246,852,530.40	75.75

### 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	300196	长海股份	6,731,891	263,688,170.47	8.89
2	000035	中国天楹	33,663,838	238,003,334.66	8.02
3	002367	康力电梯	10,732,357	165,278,297.80	5.57
4	300064	豫金刚石	16,123,755	164,139,825.90	5.53
5	002588	史丹利	12,433,621	153,555,219.35	5.18
6	601588	北辰实业	32,018,800	136,720,276.00	4.61
7	600439	瑞贝卡	20,000,000	113,400,000.00	3.82
8	002221	东华能源	7,860,269	95,816,679.11	3.23
9	002333	罗普斯金	5,397,873	52,575,283.02	1.77
10	002299	圣农发展	1,910,903	49,492,387.70	1.67
11	300012	华测检测	3,619,400	44,808,172.00	1.51
12	600759	洲际油气	4,655,015	35,285,013.70	1.19
13	002532	新界泵业	2,274,694	34,120,410.00	1.15
14	000703	恒逸石化	3,044,814	30,052,314.18	1.01
15	601689	拓普集团	832,981	27,446,723.95	0.93
16	300058	蓝色光标	2,574,359	24,997,025.89	0.84
17	600519	贵州茅台	80,000	23,353,600.00	0.79
18	000333	美的集团	965,953	22,912,405.16	0.77
19	002081	金螳螂	2,218,012	22,224,480.24	0.75
20	300144	宋城演艺	869,596	21,661,636.36	0.73
21	000903	云内动力	2,430,697	19,518,496.91	0.66
22	600198	大唐电信	890,800	17,709,104.00	0.60
23	600489	中金黄金	1,469,925	16,521,957.00	0.56
24	002400	省广股份	1,042,878	14,735,866.14	0.50

25	002583	海能达	1,154,944	13,905,525.76	0.47
26	603993	洛阳钼业	3,300,000	13,695,000.00	0.46
27	601166	兴业银行	870,000	13,258,800.00	0.45
28	002426	胜利精密	1,318,718	12,989,372.30	0.44
29	600690	青岛海尔	1,180,000	10,478,400.00	0.35
30	601318	中国平安	294,972	9,450,902.88	0.32
31	002050	三花股份	957,600	9,240,840.00	0.31
32	002108	沧州明珠	340,000	8,806,000.00	0.30
33	300059	东方财富	370,000	8,214,000.00	0.28
34	002026	山东威达	500,000	6,285,000.00	0.21
35	600138	中青旅	240,000	4,636,800.00	0.16
36	002488	金固股份	200,000	4,204,000.00	0.14
37	000639	西王食品	293,498	4,144,191.76	0.14
38	002508	老板电器	110,000	4,044,700.00	0.14
39	600837	海通证券	200,000	3,084,000.00	0.10
40	002372	伟星新材	211,230	3,033,262.80	0.10
41	002421	达实智能	167,400	2,924,478.00	0.10
42	002673	西部证券	100,000	2,586,000.00	0.09
43	002155	湖南黄金	183,000	2,410,110.00	0.08
44	600547	山东黄金	60,000	2,334,600.00	0.08
45	002323	雅百特	178,100	2,318,862.00	0.08
46	002271	东方雨虹	130,000	2,239,900.00	0.08
47	600557	康缘药业	136,450	2,228,228.50	0.08
48	300066	三川智慧	209,450	2,050,515.50	0.07
49	300349	金卡股份	46,600	2,003,800.00	0.07
50	300310	宜通世纪	47,845	1,827,200.55	0.06
51	300284	苏交科	74,400	1,756,584.00	0.06
52	603806	福斯特	33,400	1,743,146.00	0.06
53	603600	永艺股份	27,900	1,674,000.00	0.06
54	300034	钢研高纳	73,282	1,619,532.20	0.05
55	002651	利君股份	153,900	1,617,489.00	0.05
56	000596	古井贡酒	32,177	1,542,887.15	0.05
57	002036	联创电子	65,700	1,538,037.00	0.05
58	600729	重庆百货	61,400	1,522,720.00	0.05
59	300156	神雾环保	73,950	1,521,891.00	0.05
60	300109	新开源	23,900	1,517,650.00	0.05
61	002121	科陆电子	129,150	1,517,512.50	0.05
62	300285	国瓷材料	38,000	1,515,820.00	0.05
63	002113	天润数娱	49,200	1,514,868.00	0.05
64	603989	艾华集团	46,700	1,514,014.00	0.05
65	300397	天和防务	44,400	1,509,600.00	0.05
66	002540	亚太科技	173,100	1,509,432.00	0.05
67	300159	新研股份	83,600	1,508,980.00	0.05
68	002520	日发精机	101,867	1,503,556.92	0.05

69	603010	万盛股份	67,700	1,497,524.00	0.05
70	603368	柳州医药	17,200	1,493,304.00	0.05
71	002324	普利特	50,800	1,479,296.00	0.05
72	002303	美盈森	120,100	1,476,029.00	0.05
73	603868	飞科电器	24,927	1,474,432.05	0.05
74	002185	华天科技	115,630	1,471,969.90	0.05
75	000939	凯迪生态	163,700	1,465,115.00	0.05
76	002446	盛路通信	46,200	1,462,692.00	0.05
77	600135	乐凯胶片	85,700	1,458,614.00	0.05
78	600728	佳都科技	149,900	1,457,028.00	0.05
79	603338	浙江鼎力	31,600	1,456,760.00	0.05
80	300078	思创医惠	43,500	1,454,640.00	0.05
81	002116	中国海诚	97,724	1,452,178.64	0.05
82	600651	飞乐音响	114,500	1,449,570.00	0.05
83	300238	冠昊生物	33,000	1,448,040.00	0.05
84	600076	康欣新材	95,500	1,446,825.00	0.05
85	300010	立思辰	68,900	1,445,522.00	0.05
86	300195	长荣股份	77,600	1,439,480.00	0.05
87	300101	振芯科技	51,500	1,438,395.00	0.05
88	002366	台海核电	26,900	1,434,039.00	0.05
89	002727	一心堂	57,200	1,430,000.00	0.05
90	600622	嘉宝集团	103,700	1,425,875.00	0.05
91	002236	大华股份	108,600	1,422,660.00	0.05
92	300287	飞利信	106,000	1,420,400.00	0.05
93	002103	广博股份	70,200	1,418,742.00	0.05
94	002472	双环传动	58,309	1,418,074.88	0.05
95	002434	万里扬	130,200	1,416,576.00	0.05
96	002203	海亮股份	182,000	1,414,140.00	0.05
97	002585	双星新材	132,800	1,410,336.00	0.05
98	002681	奋达科技	83,400	1,407,792.00	0.05
99	002640	跨境通	79,800	1,406,076.00	0.05
100	002298	中电鑫龙	85,050	1,403,325.00	0.05
101	002071	长城影视	102,800	1,402,192.00	0.05
102	002011	盾安环境	124,200	1,400,976.00	0.05
103	000902	新洋丰	111,900	1,399,869.00	0.05
104	002325	洪涛股份	151,800	1,395,042.00	0.05
105	600566	济川药业	54,110	1,392,791.40	0.05
106	600418	江淮汽车	109,600	1,389,728.00	0.05
107	300203	聚光科技	52,600	1,388,640.00	0.05
108	300369	绿盟科技	32,777	1,386,794.87	0.05
109	002697	红旗连锁	229,200	1,384,368.00	0.05
110	300199	翰宇药业	68,022	1,384,247.70	0.05
111	601126	四方股份	131,237	1,381,925.61	0.05
112	002581	未名医药	50,700	1,381,575.00	0.05

113	600510	黑牡丹	158,400	1,381,248.00	0.05
114	300406	九强生物	64,252	1,378,205.40	0.05
115	002501	利源精制	127,600	1,378,080.00	0.05
116	603369	今世缘	102,600	1,376,892.00	0.05
117	300269	联建光电	52,800	1,371,744.00	0.05
118	300242	明家联合	39,196	1,371,468.04	0.05
119	002251	步步高	105,500	1,368,335.00	0.05
120	300207	欣旺达	53,200	1,365,644.00	0.05
121	002293	罗莱生活	99,600	1,364,520.00	0.05
122	600814	杭州解百	128,800	1,363,992.00	0.05
123	002308	威创股份	83,000	1,363,690.00	0.05
124	002690	美亚光电	58,900	1,357,056.00	0.05
125	600517	置信电气	142,500	1,355,175.00	0.05
126	000011	深物业 A	101,160	1,354,532.40	0.05
127	000400	许继电气	87,600	1,352,544.00	0.05
128	002370	亚太药业	45,800	1,351,100.00	0.05
129	300031	宝通科技	52,900	1,350,008.00	0.05
130	002002	鸿达兴业	71,700	1,347,960.00	0.05
131	002502	骅威文化	54,752	1,346,899.20	0.05
132	600267	海正药业	110,700	1,345,005.00	0.05
133	601515	东风股份	119,000	1,344,700.00	0.05
134	002250	联化科技	93,700	1,341,784.00	0.05
135	300373	扬杰科技	55,600	1,340,516.00	0.05
136	603969	银龙股份	100,400	1,338,332.00	0.05
137	002721	金一文化	69,200	1,337,636.00	0.05
138	000967	盈峰环境	60,200	1,335,838.00	0.05
139	002551	尚荣医疗	57,100	1,334,998.00	0.05
140	002424	贵州百灵	77,600	1,334,720.00	0.04
141	002641	永高股份	161,700	1,332,408.00	0.04
142	300124	汇川技术	68,600	1,330,840.00	0.04
143	000926	福星股份	113,400	1,330,182.00	0.04
144	002592	八菱科技	40,300	1,329,900.00	0.04
145	601339	百隆东方	209,185	1,328,324.75	0.04
146	600409	三友化工	196,900	1,327,106.00	0.04
147	000591	太阳能	87,800	1,324,902.00	0.04
148	002648	卫星石化	146,400	1,323,456.00	0.04
149	002763	汇洁股份	38,800	1,323,080.00	0.04
150	600329	中新药业	76,600	1,322,882.00	0.04
151	002327	富安娜	155,200	1,320,752.00	0.04
152	002773	康弘药业	28,350	1,319,692.50	0.04
153	000566	海南海药	120,700	1,316,837.00	0.04
154	000428	华天酒店	200,600	1,315,936.00	0.04
155	603355	莱克电气	34,510	1,314,831.00	0.04
156	603001	奥康国际	61,745	1,312,698.70	0.04

157	300288	朗玛信息	36,200	1,312,612.00	0.04
158	000663	永安林业	101,900	1,312,472.00	0.04
159	603883	老百姓	26,324	1,309,355.76	0.04
160	600387	海越股份	101,000	1,305,930.00	0.04
161	601700	风范股份	178,700	1,302,723.00	0.04
162	600572	康恩贝	200,950	1,302,156.00	0.04
163	300436	广生堂	21,200	1,302,104.00	0.04
164	300359	全通教育	43,750	1,297,625.00	0.04
165	002531	天顺风能	202,285	1,296,646.85	0.04
166	600604	市北高新	54,000	1,296,000.00	0.04
167	002285	世联行	166,220	1,294,853.80	0.04
168	600399	抚顺特钢	200,000	1,294,000.00	0.04
169	600816	安信信托	76,700	1,293,929.00	0.04
170	002672	东江环保	74,600	1,292,818.00	0.04
171	600841	上柴股份	92,100	1,286,637.00	0.04
172	002584	西陇科学	96,500	1,284,415.00	0.04
173	603898	好莱客	41,300	1,284,017.00	0.04
174	000732	泰禾集团	66,000	1,283,040.00	0.04
175	603111	康尼机电	95,600	1,282,952.00	0.04
176	600077	宋都股份	264,800	1,281,632.00	0.04
177	000888	峨眉山 A	106,200	1,278,648.00	0.04
178	600064	南京高科	85,500	1,278,225.00	0.04
179	600185	格力地产	205,400	1,275,534.00	0.04
180	300271	华宇软件	67,400	1,275,208.00	0.04
181	603718	海利生物	77,648	1,274,980.16	0.04
182	002228	合兴包装	229,100	1,273,796.00	0.04
183	002152	广电运通	77,250	1,269,990.00	0.04
184	000501	鄂武商 A	80,923	1,269,681.87	0.04
185	000971	高升控股	50,900	1,268,428.00	0.04
186	000987	越秀金控	98,250	1,267,425.00	0.04
187	600987	航民股份	104,379	1,265,073.48	0.04
188	000796	凯撒旅游	72,300	1,263,804.00	0.04
189	002261	拓维信息	91,340	1,263,232.20	0.04
190	000810	创维数字	69,900	1,263,093.00	0.04
191	600062	华润双鹤	69,200	1,260,824.00	0.04
192	600057	象屿股份	122,500	1,259,300.00	0.04
193	300376	易事特	46,100	1,258,069.00	0.04
194	600979	广安爱众	213,000	1,256,700.00	0.04
195	600917	重庆燃气	126,100	1,254,695.00	0.04
196	600617	国新能源	109,475	1,254,583.50	0.04
197	300190	维尔利	72,198	1,254,079.26	0.04
198	300367	东方网力	50,500	1,253,915.00	0.04
199	000563	陕国投 A	228,300	1,253,367.00	0.04
200	603555	贵人鸟	50,100	1,248,993.00	0.04

201	000528	柳 工	192,700	1,248,696.00	0.04
202	002542	中化岩土	164,450	1,246,531.00	0.04
203	300182	捷成股份	72,400	1,238,764.00	0.04
204	002624	完美世界	32,800	1,238,200.00	0.04
205	002751	易尚展示	19,300	1,235,393.00	0.04
206	300392	腾信股份	45,600	1,234,848.00	0.04
207	002408	齐翔腾达	224,900	1,234,701.00	0.04
208	600801	华新水泥	195,648	1,234,538.88	0.04
209	600587	新华医疗	53,400	1,233,006.00	0.04
210	002143	印纪传媒	52,555	1,231,363.65	0.04
211	600823	世茂股份	181,240	1,230,619.60	0.04
212	600093	禾嘉股份	98,381	1,220,908.21	0.04
213	600548	深高速	156,300	1,217,577.00	0.04
214	600606	绿地控股	112,400	1,216,168.00	0.04
215	002707	众信旅游	59,800	1,213,940.00	0.04
216	600054	黄山旅游	75,300	1,211,577.00	0.04
217	300063	天龙集团	40,600	1,209,068.00	0.04
218	002188	巴士在线	41,700	1,206,381.00	0.04
219	600477	杭萧钢构	176,380	1,202,911.60	0.04
220	603899	晨光文具	67,800	1,200,060.00	0.04
221	600053	九鼎投资	34,400	1,191,272.00	0.04
222	002504	弘高创意	49,100	1,188,220.00	0.04
223	002019	亿帆鑫富	76,300	1,173,494.00	0.04
224	603588	高能环境	43,000	1,171,750.00	0.04
225	002442	龙星化工	84,300	1,152,381.00	0.04
226	300343	联创互联	52,600	1,141,946.00	0.04
227	002516	旷达科技	189,000	1,139,670.00	0.04
228	002373	千方科技	73,200	1,093,608.00	0.04
229	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
230	300334	津膜科技	41,200	743,660.00	0.03
231	601021	春秋航空	15,000	719,100.00	0.02
232	300370	安控科技	59,300	673,648.00	0.02
233	603199	九华旅游	13,900	658,860.00	0.02
234	601313	江南嘉捷	45,000	651,600.00	0.02
235	300210	森远股份	35,600	636,528.00	0.02
236	601015	陕西黑猫	54,600	631,722.00	0.02
237	300385	雪浪环境	17,200	613,524.00	0.02
238	300363	博腾股份	24,700	613,054.00	0.02
239	300337	银邦股份	77,300	608,351.00	0.02
240	603100	川仪股份	37,800	603,288.00	0.02
241	600707	彩虹股份	50,000	590,000.00	0.02
242	002255	海陆重工	68,400	588,924.00	0.02
243	300194	福安药业	27,140	587,581.00	0.02
244	300396	迪瑞医疗	13,600	585,888.00	0.02

245	300303	聚飞光电	61,500	584,865.00	0.02
246	000705	浙江震元	41,400	583,326.00	0.02
247	300286	安科瑞	19,600	581,924.00	0.02
248	600121	郑州煤电	120,200	576,960.00	0.02
249	300320	海达股份	43,800	576,846.00	0.02
250	300121	阳谷华泰	41,700	570,873.00	0.02
251	300200	高盟新材	35,000	570,500.00	0.02
252	002194	武汉凡谷	44,400	567,432.00	0.02
253	300354	东华测试	21,100	566,535.00	0.02
254	601116	三江购物	48,100	559,884.00	0.02
255	300103	达刚路机	29,900	559,130.00	0.02
256	600698	湖南天雁	93,900	555,888.00	0.02
257	002666	德联集团	60,100	555,324.00	0.02
258	600681	百川能源	51,200	555,008.00	0.02
259	300448	浩云科技	15,538	554,706.60	0.02
260	002728	台城制药	21,500	552,550.00	0.02
261	300120	经纬电材	37,200	551,676.00	0.02
262	600714	金瑞矿业	43,300	549,910.00	0.02
263	300154	瑞凌股份	53,000	547,490.00	0.02
264	600243	青海华鼎	53,600	546,720.00	0.02
265	300175	朗源股份	60,400	546,016.00	0.02
266	300139	晓程科技	37,100	545,741.00	0.02
267	300415	伊之密	31,800	545,688.00	0.02
268	002014	永新股份	34,200	545,490.00	0.02
269	300082	奥克股份	70,000	545,300.00	0.02
270	000908	景峰医药	45,110	544,928.80	0.02
271	002397	梦洁股份	65,900	542,357.00	0.02
272	603015	弘讯科技	38,900	540,321.00	0.02
273	002088	鲁阳节能	34,700	539,932.00	0.02
274	000628	高新发展	40,800	539,784.00	0.02
275	002017	东信和平	37,200	535,680.00	0.02
276	600148	长春一东	24,200	533,126.00	0.02
277	600844	丹化科技	82,200	531,012.00	0.02
278	002578	闽发铝业	56,300	530,909.00	0.02
279	002541	鸿路钢构	30,800	530,684.00	0.02
280	000544	中原环保	37,100	530,159.00	0.02
281	300281	金明精机	35,600	528,304.00	0.02
282	000859	国风塑业	98,400	527,424.00	0.02
283	300357	我武生物	14,000	527,240.00	0.02
284	600080	金花股份	45,000	526,500.00	0.02
285	300179	四方达	68,800	525,632.00	0.02
286	002062	宏润建设	88,700	525,104.00	0.02
287	600723	首商股份	58,600	523,298.00	0.02
288	000026	飞亚达 A	45,400	518,922.00	0.02

289	600078	澄星股份	80,200	518,894.00	0.02
290	603939	益丰药房	15,900	518,658.00	0.02
291	600976	健民集团	19,300	518,205.00	0.02
292	002300	太阳电缆	53,200	517,636.00	0.02
293	000419	通程控股	71,100	517,608.00	0.02
294	601999	出版传媒	54,200	515,984.00	0.02
295	300107	建新股份	80,200	514,884.00	0.02
296	601798	蓝科高新	41,900	512,437.00	0.02
297	600561	江西长运	41,900	512,018.00	0.02
298	300214	日科化学	66,400	511,280.00	0.02
299	300150	世纪瑞尔	47,100	510,093.00	0.02
300	000523	广州浪奇	46,800	508,716.00	0.02
301	300237	美晨科技	54,000	508,680.00	0.02
302	300164	通源石油	63,900	508,644.00	0.02
303	600281	太化股份	82,000	508,400.00	0.02
304	601177	杭齿前进	51,550	508,283.00	0.02
305	600222	太龙药业	63,700	507,689.00	0.02
306	300129	泰胜风能	72,500	507,500.00	0.02
307	002258	利尔化学	54,000	507,060.00	0.02
308	600483	福能股份	44,600	506,210.00	0.02
309	000906	物产中拓	42,600	505,662.00	0.02
310	600505	西昌电力	56,600	504,872.00	0.02
311	002420	毅昌股份	58,000	504,600.00	0.02
312	002187	广百股份	40,927	504,220.64	0.02
313	300172	中电环保	54,550	502,405.50	0.02
314	603099	长白山	28,000	501,480.00	0.02
315	600272	开开实业	28,500	501,315.00	0.02
316	002307	北新路桥	63,800	500,830.00	0.02
317	603030	全筑股份	18,300	500,688.00	0.02
318	600810	神马股份	67,000	500,490.00	0.02
319	300138	晨光生物	29,900	499,330.00	0.02
320	002302	西部建设	69,100	498,902.00	0.02
321	600248	延长化建	81,710	498,431.00	0.02
322	600889	南京化纤	46,154	497,540.12	0.02
323	000789	万年青	80,400	496,872.00	0.02
324	603558	健盛集团	26,300	496,281.00	0.02
325	002391	长青股份	34,700	496,210.00	0.02
326	600579	天华院	36,400	495,768.00	0.02
327	000756	新华制药	46,200	495,726.00	0.02
328	002693	双成药业	52,400	495,704.00	0.02
329	002487	大金重工	56,000	495,600.00	0.02
330	000429	粤高速 A	90,100	495,550.00	0.02
331	300272	开能环保	32,100	495,303.00	0.02
332	600361	华联综超	79,400	494,662.00	0.02

333	600858	银座股份	60,100	492,219.00	0.02
334	600126	杭钢股份	82,000	492,000.00	0.02
335	600239	云南城投	106,000	491,840.00	0.02
336	600802	福建水泥	61,300	490,400.00	0.02
337	600223	鲁商置业	96,100	490,110.00	0.02
338	601616	广电电气	86,500	489,590.00	0.02
339	600824	益民集团	82,000	489,540.00	0.02
340	600819	耀皮玻璃	78,400	488,432.00	0.02
341	600719	大连热电	65,400	486,576.00	0.02
342	002561	徐家汇	39,900	485,184.00	0.02
343	600665	天地源	99,700	483,545.00	0.02
344	601008	连云港	102,000	483,480.00	0.02
345	603456	九洲药业	18,700	482,834.00	0.02
346	000678	襄阳轴承	60,600	478,740.00	0.02
347	603566	普莱柯	20,900	459,591.00	0.02
348	002687	乔治白	37,600	450,824.00	0.02
349	300305	裕兴股份	18,800	260,568.00	0.01
350	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
351	600000	浦发银行	14,240	221,716.80	0.01
352	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
353	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
354	600455	博通股份	3,200	157,248.00	0.01
355	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
356	002101	广东鸿图	3,700	79,994.00	0.00
357	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
358	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
359	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
360	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
361	000985	大庆华科	1,800	44,514.00	0.00
362	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
363	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
364	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
365	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
366	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
367	002805	丰元股份	971	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	600519	贵州茅台	276,375,944.04	5.92
2	000035	中国天楹	228,168,838.32	4.89
3	601588	北辰实业	214,042,389.79	4.58
4	000333	美的集团	203,275,700.06	4.35
5	300005	探路者	182,025,382.41	3.90
6	002367	康力电梯	180,538,677.48	3.87
7	002588	史丹利	177,387,529.25	3.80
8	600162	香江控股	174,748,791.25	3.74
9	300064	豫金刚石	158,944,840.65	3.40
10	300133	华策影视	135,488,524.49	2.90
11	600439	瑞贝卡	121,406,903.38	2.60
12	300398	飞凯材料	110,261,022.45	2.36
13	000939	凯迪生态	102,255,650.43	2.19
14	600894	广日股份	100,984,308.98	2.16
15	002081	金螳螂	94,545,881.20	2.02
16	300259	新天科技	92,221,003.12	1.97
17	002271	东方雨虹	91,586,098.93	1.96
18	002658	雪迪龙	88,561,980.25	1.90
19	002078	太阳纸业	83,873,121.71	1.80
20	600820	隧道股份	82,830,283.83	1.77

## 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	600519	贵州茅台	268,937,532.10	5.76
2	002236	大华股份	228,150,254.17	4.89
3	002078	太阳纸业	207,813,232.01	4.45
4	601169	北京银行	204,114,490.20	4.37
5	601166	兴业银行	201,546,355.17	4.32
6	300133	华策影视	197,598,250.36	4.23
7	000333	美的集团	193,263,711.93	4.14
8	600162	香江控股	178,074,854.29	3.81
9	002400	省广股份	173,978,560.21	3.73
10	300005	探路者	168,422,427.34	3.61
11	000939	凯迪生态	161,977,447.22	3.47
12	601688	华泰证券	144,776,374.11	3.10
13	002081	金螳螂	139,917,206.65	3.00
14	002475	立讯精密	138,525,386.44	2.97
15	000035	中国天楹	128,459,256.54	2.75
16	300398	飞凯材料	120,832,132.24	2.59
17	300259	新天科技	115,427,453.56	2.47

18	000858	五粮液	111,418,661.98	2.39
19	300012	华测检测	108,643,687.73	2.33
20	600837	海通证券	99,743,547.45	2.14
21	600180	瑞茂通	98,534,638.26	2.11

#### 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	6,314,253,773.78
卖出股票的收入（成交）总额	7,533,820,048.49

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

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

本基金本报告期末投资股指期货。

##### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体，本期未出现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、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	2,479,953.59
2	应收证券清算款	245,683,432.08
3	应收股利	-
4	应收利息	97,389.32
5	应收申购款	67,252.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	248,328,027.44

### 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

本基金报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

## 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
147,657	16,631.98	80,955,648.01	3.30%	2,374,872,401.80	96.70%

### 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	0.86	0.00%

### 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（2007年8月24日）基金份额总额	9,905,973,604.86
---------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	3,162,587,338.22
本报告期基金总申购份额	373,542,202.60
减：本报告期基金总赎回份额	1,080,301,491.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,455,828,049.81

## 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	
银河证券	1	66,043,698.10	0.48%	61,505.67	0.48%	-
中银国际	1	185,162,551.59	1.34%	172,441.65	1.35%	-

海通证券	1	424,549,090.76	3.07%	395,380.77	3.11%	-
东兴证券	1	480,213,308.78	3.47%	447,223.64	3.51%	-
中信证券	1	591,135,144.65	4.27%	550,523.17	4.32%	-
兴业证券	1	631,548,793.46	4.56%	588,160.42	4.62%	-
东方证券	2	678,950,994.73	4.90%	618,727.94	4.86%	-
国信证券	1	836,594,539.12	6.04%	779,122.90	6.12%	-
中信建投	2	920,384,514.52	6.65%	845,662.37	6.64%	-
华泰证券	3	932,476,663.66	6.73%	851,727.76	6.69%	-
招商证券	1	1,044,262,658.80	7.54%	972,520.18	7.64%	-
安信证券	1	1,083,539,805.67	7.83%	1,009,099.47	7.92%	-
国泰君安	1	1,268,476,384.06	9.16%	1,155,961.07	9.08%	-
中金公司	1	1,466,998,590.09	10.60%	1,336,877.07	10.50%	-
国金证券	2	1,541,136,643.96	11.13%	1,404,437.55	11.03%	-
申银万国	1	1,694,506,248.75	12.24%	1,544,208.81	12.13%	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	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

报告期内新增广州证券交易单元。

报告期内无撤销证券交易单元。

（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（2）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
银河证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	2,173,000,000.00	17.92%	-	-
海通证券	-	-	520,000,000.00	4.29%	-	-
东兴证券	-	-	1,290,000,000.00	10.64%	-	-
中信证券	-	-	554,000,000.00	4.57%	-	-
兴业证券	-	-	610,000,000.00	5.03%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	2,070,000,000.00	17.07%	-	-
中信建投	3,237,404.18	100.00%	1,075,000,000.00	8.87%	-	-
华泰证券	-	-	270,000,000.00	2.23%	-	-
招商证券	-	-	1,150,000,000.00	9.48%	-	-
安信证券	-	-	2,413,000,000.00	19.90%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
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	光大保德信优势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	光大保德信优势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
6	光大保德信优势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
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	光大保德信优势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》	2016-04-02
9	光大保德信优势配置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》	2016-04-07
10	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
11	光大保德信优势配置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》	2016-04-08
12	光大保德信优势配置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》	2016-04-08
13	光大保德信优势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
14	光大保德信优势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》	2016-04-26
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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-18

	告		
19	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优势配置混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信优势配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信优势配置混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信优势配置混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信优势配置混合型证券投资基金法律意见书
- 6、光大保德信优势配置混合型证券投资基金财务报表及报表附注
- 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](http://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