

九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：九泰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 19 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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	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合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
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.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53

7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误!未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.4 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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	九泰久盛量化先锋混合
基金主代码	001897
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 10 日
基金管理人	九泰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	182,105,394.70 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用多策略量化模型，在有效控制组合风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金是混合型基金，主要目的是在市场中找出具有投资价值的标的，实现资产的长期保值增值，投资主要依托于量化多策略体系平台来实现。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中等风险收益特征的证券投资基金品种。

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		九泰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢海波	洪渊
	联系电话	010-52601690	010-66105799
	电子邮箱	service@jtamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-628-0606	95588
传真		010-66067330	010-66105798
注册地址		北京市丰台区丽泽路 18 号院 1 号楼 801-16 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		卢伟忠	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	本基金选定的信息披露报纸为 《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.jtamc.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	九泰基金管理有限公司	北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦西区 6 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 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-19,102,095.12
本期利润	-17,498,334.75
加权平均基金份额本期利润	-0.0880
本期加权平均净值利润率	-9.91%
本期基金份额净值增长率	-6.24%
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	-10,820,826.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0594
期末基金资产净值	177,671,993.27
期末基金份额净值	0.976
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	-2.40%

注：1、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；

2、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；

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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

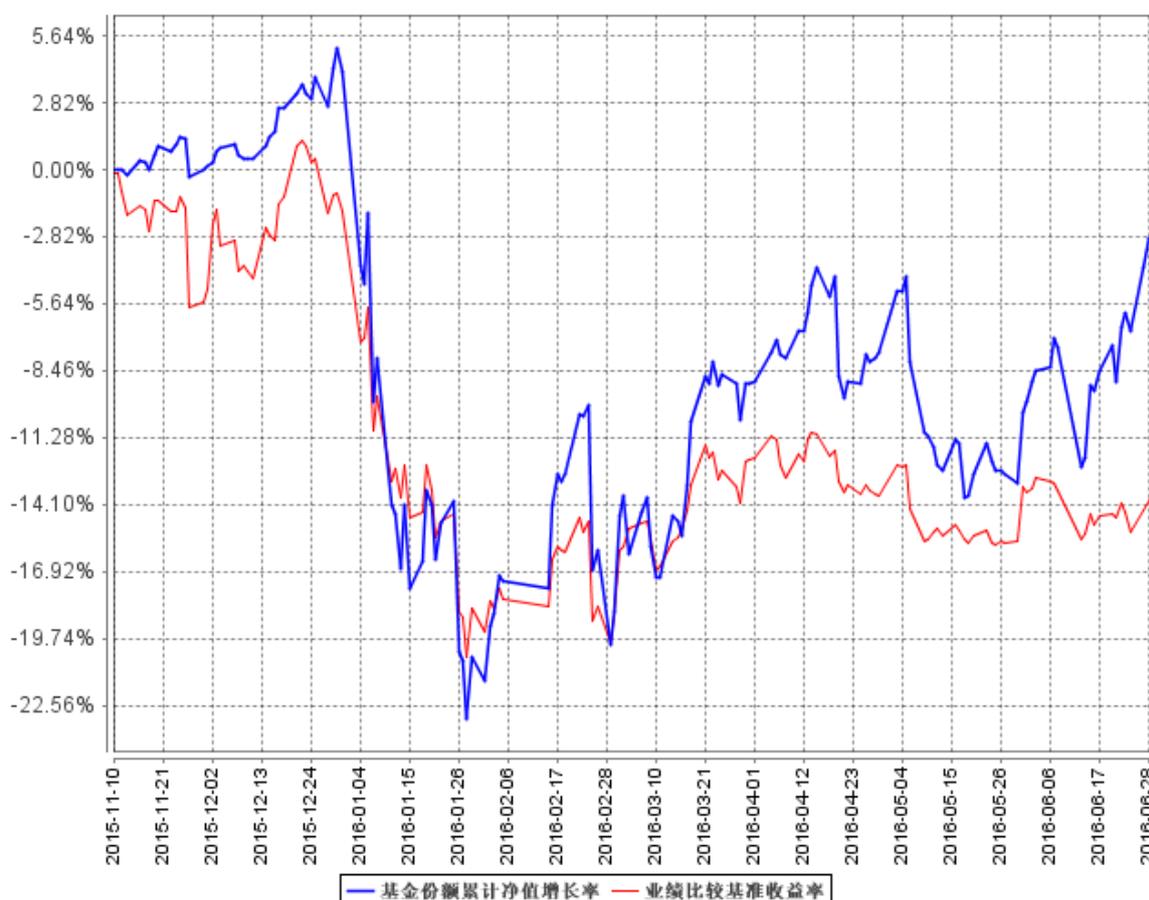
3.2 基金净值表现

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	8.69%	1.83%	-0.23%	0.79%	8.92%	1.04%
过去三个月	7.25%	1.62%	-1.50%	0.81%	8.75%	0.81%
过去六个月	-6.24%	2.42%	-12.05%	1.47%	5.81%	0.95%
自基金合同生效起至今	-2.40%	2.13%	-13.56%	1.42%	11.16%	0.71%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，截至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

2. 根据基金合同的规定，自本基金合同生效之日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

九泰基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2014】650 号文批准，于 2014 年 7 月 3 日正式成立，现注册资本 2 亿元人民币，其中昆吾九鼎投资管理有限公司、同创九鼎投资管理集团股份有限公司、拉萨昆吾九鼎产业投资管理有限公司和九州证券股份有限公司分别占注册资本 26%、25%、25%和 24%的股权。截至本报告期末（2016 年 6 月 30 日），基金管理人共管理七只开放式证券投资基金，包括九泰天富改革新动力灵活配置混合型证券投资基金、九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金、九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金、九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金、九泰日添金货币市场基金、九泰锐富事件驱动混合型发起式证券投资基金、九泰久稳保本混合型证券投资基金，证券投资基金规模约为 69.33 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王玥晰	基金经理	2015 年 11 月 10 日	-	8	经济系金融经济学硕士，中国籍，全国银行间同业拆解市场本币交易员。8 年证券从业经验，具有基金从业资格。历任诺安基金管理有限公司债券交易员，基金经理助理，诺安货币市场基金 A/B 基金经理（2013 年 7 月 31 日至 2015 年 1 月 6 日）。2015 年 6 月加入九泰基金管理有限公司担任基金经理。
孟亚强	基金经理	2016 年 6 月 7 日	-	7	南开大学保险精算硕士，中国籍，具有基金从业资格。7 年证券从业经历。历任博时基金管理有限公司量化研究员、基金经理助理、投资经理。2015 年 8 月加入九泰基金管理有限公司任任绝对收益部基金经理。

注：上述人员的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，证券从业年限计算的起始时间按照从事证券行业开始时间计算。九泰基金管理有限公司于 2016 年 6 月 21 日发布公告称，聘请孟亚强先生担任本基金的基金经理，与王玥晰女士共同管理本基金。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的半年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2 季度市场风格轮动明显加快，但总体小盘风格仍占优。模型在 5 月份受大小盘风格快速切换影响，导致 5 月整体持仓呈现大盘风格，表现相当一般，但随着市场风格的企稳，模型迅速调整持仓，在 6 月份的反弹行情中把握住了一定的机会。在 2 季度各个策略的表现中，量化主题和事件驱动策略表现相对较好，而且动量效应相当持续，特别是白酒、新材料以及锂电池等主题等表现突出，本基金在发现投资机会后，也捕捉到了一定的投资机会。

运作分析：本基金采用量化多策略模型运作，2 季度中市场风格变化较为剧烈，但整体体现为小盘和反转风格，价值风格仅仅是昙花一现。本基金在 2 季度中由于小盘风格的短暂回调而重仓大盘股，整体表现一般。在 6 月份后期小盘风格的快速反弹中，我们加快了模型的调整，把握到了一定的投资机会。整体上半年来看，主题轮动表现较为出色，特别是以稀土永磁、锂电池带动的上下游产业链机会表现较为突出，而且动量效应相当持续，模型在这些事件的中期捕捉到了一定的投资机会，除此以外，上半年的事件驱动策略也是一大亮点，以股权激励和高送转为代表

的事件表现较好。未来我们仍然坚持量化策略轮动的思路，捕捉投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率为-6.24%，同期业绩比较基准收益率为-12.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，资金宽松格局不会有根本改变，债券面临着违约和去杠杆的困境，缺乏吸引力，房地产虽经历了年初局部牛市，但整体仍处于去库存的过程中，资金仍会偏向股市和大宗商品特别是贵金属。短暂的市场下跌有望迎来小规模的增量资金的进入。拥抱新经济，寻找具有需求支撑的科技股、新材料仍是未来配置的重点，从估值的角度讲，化工、化纤、电力、航空、食品、医药、有色等板块仍具备足够的吸引力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由督察长、公司总裁助理、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程的各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分

配原则的约定，本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至 2016 年 6 月 30 日，期末可供分配利润为-10,820,826.49 元，其中：未分配利润已实现部分为-10,820,826.49 元，未分配利润未实现部分为 6,387,425.06 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

本基金本报告期内未发生连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金的管理人——九泰基金管理有限公司在九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，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，九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对九泰基金管理有限公司编制和披露的九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	12,486,482.67	22,841,134.47
结算备付金		3,729,727.72	13,146,656.12
存出保证金		1,172,657.48	26,311.46
交易性金融资产	6.4.7.2	163,929,319.69	203,008,924.02
其中: 股票投资		163,929,319.69	202,548,104.02
基金投资		-	-
债券投资		-	460,820.00
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	-	-
应收证券清算款		768,754.62	410,264.50
应收利息	6.4.7.5	4,223.21	17,626.26
应收股利		-	-
应收申购款		18,670.79	580,113.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		182,109,836.18	240,031,030.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		213,723.47	-
应付赎回款		2,196,025.72	7,995,735.06
应付管理人报酬		211,764.81	409,320.64
应付托管费		35,294.15	68,220.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,688,219.03	325,515.68
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	92,815.73	19,969.96
负债合计		4,437,842.91	8,818,761.46
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	182,105,394.70	222,130,970.75
未分配利润	6.4.7.10	-4,433,401.43	9,081,298.49
所有者权益合计		177,671,993.27	231,212,269.24

负债和所有者权益总计		182,109,836.18	240,031,030.70
------------	--	----------------	----------------

注：1、报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 0.976 元，基金份额总额为 182,105,394.70 份；

2、本基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，上年度资产负债表的实际编制期间为 2015 年 11 月 10 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

6.2 利润表

会计主体：九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-11,053,293.28
1.利息收入		119,761.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	111,719.07
债券利息收入		1,326.87
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		6,715.65
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,896,882.68
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,386,009.94
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	43,482.42
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	34,946.67
股利收益	6.4.7.15	410,698.17
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,603,760.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	120,067.44
减：二、费用		6,445,041.47
1. 管理人报酬		1,320,170.61
2. 托管费		220,028.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	4,817,331.19
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	87,511.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,498,334.75

中国证监会“证监许可【2015】2171号文《关于准予九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予募集注册，由九泰基金管理有限公司作为发起人于2015年10月12日至2015年11月6日向社会公开募集，募集结束经北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年11月10日生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币387,954,288.48元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币82,237.86元，以上实收基金（本息）合计为人民币388,036,526.34元，折合388,036,526.34份基金份额。本基金的基金管理人、注册登记机构均为九泰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则以及2014年颁布及经修订的准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产(负债)，并形成其他单位的金融负债(资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及应收款项。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；

(2) 存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价且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时，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值小组认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累

计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认,于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账;
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;
- (3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与预计收益率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;
- (4) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率,在实际持有期间内逐日计提;
- (5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;
- (6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账;
- (7) 资产支持证券投资收益/(损失)于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认;
- (8) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;
- (9) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;
- (10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;
- (11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 根据基金合同,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提;
- (2) 根据基金合同,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;
- (3) 卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提;

(4) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、

2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税；

(2) 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，暂不缴纳企业所得税；

(3) 对基金所持上市公司股票，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，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，2015 年 9 月 8 日之前其股息红利所得暂减按 25%计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

(4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

(5) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；

(6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	12,486,482.67
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	12,486,482.67

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	157,870,350.60	163,929,319.69	6,058,969.09
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	157,870,350.60	163,929,319.69	6,058,969.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,834,720.00	-	-	
其中：股指期货	4,834,720.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	4,834,720.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在股指期货采用当日无负债结算制度下，结算备付金已包括本基金于 2016 年 6 月 30 日所有的股指期货合约产生的持仓损益金额，因此衍生金融资产项下的股指期货投资按抵消后的净额列示，为人民币零元。于 2016 年 6 月 30 日，报告期末本基金的股指期货持仓和损益明细请见 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	2,304.90

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,244.07
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	674.24
合计	4,223.21

注：其他指应收结算保证金利息和未被占用期货保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,688,219.03
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,688,219.03

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
应付赎回费	8,226.67
审计费用	24,863.02
信息披露费用	59,726.04
合计	92,815.73

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	222,130,970.75	222,130,970.75
本期申购	5,794,102.44	5,794,102.44
本期赎回(以“-”号填列)	-45,819,678.49	-45,819,678.49

本期末	182,105,394.70	182,105,394.70
-----	----------------	----------------

注：本期申购中包含转换入份额及金额，赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,660,512.13	3,420,786.36	9,081,298.49
本期利润	-19,102,095.12	1,603,760.37	-17,498,334.75
本期基金份额交易产生的变动数	2,620,756.50	1,362,878.33	3,983,634.83
其中：基金申购款	-367,787.27	-307,998.55	-675,785.82
基金赎回款	2,988,543.77	1,670,876.88	4,659,420.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,820,826.49	6,387,425.06	-4,433,401.43

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	80,047.92
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	30,143.66
其他	1,527.49
合计	111,719.07

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,722,669,941.29
减：卖出股票成本总额	1,736,055,951.23
买卖股票差价收入	-13,386,009.94

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	43,482.42
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	43,482.42

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	461,095.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	416,000.00
减：应收利息总额	1,612.94
买卖债券差价收入	43,482.42

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年1月1日至2016年6月30日
股指期货-投资收益	34,946.67

6.4.7.15 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	410,698.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	410,698.17

6.4.7.16 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	1,468,667.04
——股票投资	1,513,487.04
——债券投资	-44,820.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	135,093.33
——权证投资	-
期货投资	135,093.33
3. 其他	-
合计	1,603,760.37

6.4.7.17 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	119,922.81
转换费收入	144.63
合计	120,067.44

6.4.7.18 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	4,817,079.32
银行间市场交易费用	-
股指期货交易费用	251.87
合计	4,817,331.19

6.4.7.19 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	24,863.02
信息披露费	49,726.04

银行汇划费	2,122.18
中债登帐户维护费	6,000.00
上清所帐户维护费	4,500.00
其他	300.00
合计	87,511.24

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，本基金无需要说明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

1. 2016 年 2 月 22 日，基金管理人股东“九州证券有限公司”变更名称为“九州证券股份有限公司”；

2. 2016 年 3 月 28 日，基金管理人全资控股子公司九泰基金销售（北京）管理有限公司受让九泰财富管理有限公司 100% 股权。

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
九泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行交易。

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
当期发生的基金应支付	1,320,170.61

的管理费	
其中：支付销售机构的客户维护费	792,260.27

注：本基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，无上年度可比期间。

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

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
当期发生的基金应支付的托管费	220,028.43

注：本基金合同于 2015 年 11 月 10 日生效，无上年度可比期间。

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	12,486,482.67	80,047.92

注：本基金合同于2015年11月10日生效，无上年度可比期间。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期间无需说明的其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,205	15,640.90	15,640.90	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,264	10,731.36	10,731.36	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-

			日							
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600734	实达集团	2016年4月20日	重大事项停牌	14.60	-	-	235,515	3,163,335.98	3,438,519.00	-
600455	博通股份	2016年5月5日	重大事项停牌	49.14	-	-	63,154	2,993,887.16	3,103,387.56	-
300385	雪浪环境	2016年6月21日	重大事项停牌	35.67	2016年7月5日	37.38	70,856	2,317,166.65	2,527,433.52	-
000498	山东路桥	2016年6月20日	重大事项停牌	5.76	2016年7月4日	6.11	333,200	2,016,660.12	1,919,232.00	-
000551	创元科技	2016年6月7日	重大事项停牌	9.18	2016年7月7日	10.10	205,651	1,888,765.67	1,887,876.18	-
600475	华光股份	2016年5月18日	重大事项停牌	14.85	-	-	91,600	1,351,253.50	1,360,260.00	-
603606	东方电缆	2016年6月22日	重大事项停牌	13.85	2016年7月5日	15.13	58,600	722,285.06	811,610.00	-
600203	福日电子	2016年6月30日	重大事项停牌	13.80	2016年7月1日	13.25	30,300	366,394.29	418,140.00	-
600237	铜峰电子	2016年6月30日	重大事项停牌	7.61	2016年7月7日	7.42	46,600	364,494.91	354,626.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，一般情况下其预期风险与预期收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金，属于中等风险收益特征的证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资、资产支持证券投资及股指期货投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制投资风险的前提下，力争为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人建立了董事会及风险控制委员会、总经理、风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风控法务部以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。董事会负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度。董事会下设风险控制委员会，风险控制委员会负责对公司经营管理与资产组合运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查；总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险管理委员会，负责审议公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等，重点是公司的合规控制和投资的风险控制；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部和风控法务部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风控法务部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的

交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风控法务部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标等。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的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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2016 年 06 月 30 日，本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

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、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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	12,486,482.67	-	-	-	-	-	12,486,482.67
结算备付金	3,729,727.72	-	-	-	-	-	3,729,727.72
存出保证金	157,366.28	-	-	-	-	1,015,291.20	1,172,657.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	163,929,319.69	163,929,319.69
应收证券清算款	-	-	-	-	-	768,754.62	768,754.62
应收利息	-	-	-	-	-	4,223.21	4,223.21
应收申购款	1,491.06	-	-	-	-	17,179.73	18,670.79
资产总计	16,375,067.73	-	-	-	-	165,734,768.45	182,109,836.18
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	213,723.47	213,723.47
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,196,025.72	2,196,025.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	211,764.81	211,764.81
应付托管费	-	-	-	-	-	35,294.15	35,294.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,688,219.03	1,688,219.03
其他负债	-	-	-	-	-	92,815.73	92,815.73
负债总计	-	-	-	-	-	4,437,842.91	4,437,842.91
利率敏感度缺口	16,375,067.73	-	-	-	-	161,296,925.54	177,671,993.27
上年度末	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

2015 年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	22,841,134.47	-	-	-	-	-	22,841,134.47
结算备付金	13,146,656.12	-	-	-	-	-	13,146,656.12
存出保证金	26,311.46	-	-	-	-	-	26,311.46
交易性金融资产	-	-	116,000.00	344,820.00	-	-202,548,104.02	203,008,924.02
应收证券清算款	-	-	-	-	-	410,264.50	410,264.50
应收利息	-	-	-	-	-	17,626.26	17,626.26
应收申购款	53,191.30	-	-	-	-	526,922.57	580,113.87
资产总计	36,067,293.35	-	116,000.00	344,820.00	-	-203,502,917.35	240,031,030.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,995,735.06	7,995,735.06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	409,320.64	409,320.64
应付托管费	-	-	-	-	-	68,220.12	68,220.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	325,515.68	325,515.68
其他负债	-	-	-	-	-	19,969.96	19,969.96
负债总计	-	-	-	-	-	8,818,761.46	8,818,761.46
利率敏感度缺口	36,067,293.35	-	116,000.00	344,820.00	-	-194,684,155.89	231,212,269.24

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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	163,929,319.69	92.27	202,548,104.02	87.60
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	460,820.00	0.20
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	163,929,319.69	92.27	203,008,924.02	87.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%		10,870,621.31
2. 沪深 300 指数下降 5%		-10,870,621.31	-

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款及应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重

要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为 147,982,554.71 元，属于第二层次的余额为 15,946,764.98 元，无属于第三层次的余额。（2015 年 12 月 31 日，第一层次的余额为 199,636,648.02 元，第二层次的余额为 2,911,456.00 元，无属于第三层次的余额。）

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 6.4.4.5。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，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	163,929,319.69	90.02
	其中：股票	163,929,319.69	90.02
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	-	-
	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	16,216,210.39	8.90
7	其他各项资产	1,964,306.10	1.08
8	合计	182,109,836.18	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,582,526.15	3.14
B	采矿业	492,322.24	0.28
C	制造业	89,682,438.39	50.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,024,655.43	2.27
E	建筑业	3,196,017.11	1.80
F	批发和零售业	10,760,611.09	6.06
G	交通运输、仓储和邮政业	2,614,858.52	1.47
H	住宿和餐饮业	125,300.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,350,438.69	15.39
J	金融业	1,086,719.20	0.61
K	房地产业	5,388,763.91	3.03
L	租赁和商务服务业	2,839,809.00	1.60
M	科学研究和技术服务业	535,012.65	0.30
N	水利、环境和公共设施管理业	1,197,707.22	0.67
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	4,060,876.35	2.29
S	综合	4,991,263.74	2.81
	合计	163,929,319.69	92.27

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	600734	实达集团	235,515	3,438,519.00	1.94
2	600455	博通股份	63,154	3,103,387.56	1.75
3	300385	雪浪环境	70,856	2,527,433.52	1.42
4	000952	广济药业	124,149	2,093,152.14	1.18
5	000498	山东路桥	333,200	1,919,232.00	1.08
6	000551	创元科技	205,651	1,887,876.18	1.06
7	600242	中昌海运	117,400	1,815,004.00	1.02
8	000698	沈阳化工	270,636	1,769,959.44	1.00
9	002208	合肥城建	90,600	1,759,452.00	0.99
10	300063	天龙集团	54,500	1,623,010.00	0.91
11	600757	长江传媒	176,169	1,478,057.91	0.83
12	002234	民和股份	47,704	1,402,974.64	0.79
13	002458	益生股份	31,873	1,396,356.13	0.79
14	002493	荣盛石化	113,785	1,379,074.20	0.78
15	002124	天邦股份	128,540	1,368,951.00	0.77
16	600475	华光股份	91,600	1,360,260.00	0.77
17	002131	利欧股份	76,561	1,308,427.49	0.74
18	300229	拓尔思	57,634	1,232,214.92	0.69
19	000708	大冶特钢	109,748	1,229,177.60	0.69
20	300250	初灵信息	41,120	1,216,740.80	0.68
21	600233	大杨创世	60,600	1,179,276.00	0.66
22	002468	艾迪西	39,800	1,139,076.00	0.64
23	600984	建设机械	130,500	1,128,825.00	0.64
24	002110	三钢闽光	183,100	1,105,924.00	0.62
25	000599	青岛双星	159,200	1,095,296.00	0.62
26	000059	华锦股份	116,886	1,087,039.80	0.61
27	000703	恒逸石化	109,600	1,081,752.00	0.61
28	600168	武汉控股	109,550	1,069,208.00	0.60
29	300290	荣科科技	57,463	1,055,595.31	0.59
30	603003	龙宇燃油	55,001	1,053,819.16	0.59
31	002006	精功科技	77,639	1,050,455.67	0.59
32	300235	方直科技	41,200	1,023,820.00	0.58
33	600410	华胜天成	86,960	975,691.20	0.55
34	002649	博彦科技	23,300	921,981.00	0.52
35	600756	浪潮软件	29,600	890,960.00	0.50

36	600595	中孚实业	153,692	866,822.88	0.49
37	002655	共达电声	51,902	838,217.30	0.47
38	002329	皇氏集团	55,658	834,313.42	0.47
39	002362	汉王科技	29,949	823,298.01	0.46
40	300188	美亚柏科	30,900	823,176.00	0.46
41	002231	奥维通信	52,902	817,864.92	0.46
42	300231	银信科技	44,177	814,623.88	0.46
43	603606	东方电缆	58,600	811,610.00	0.46
44	300010	立思辰	37,760	792,204.80	0.45
45	000863	三湘股份	84,300	775,560.00	0.44
46	000967	盈峰环境	33,053	733,446.07	0.41
47	002640	跨境通	41,000	722,420.00	0.41
48	300467	迅游科技	11,600	717,808.00	0.40
49	300118	东方日升	38,000	716,680.00	0.40
50	002503	搜于特	56,950	707,319.00	0.40
51	002626	金达威	41,000	690,850.00	0.39
52	000488	晨鸣纸业	87,000	690,780.00	0.39
53	600826	兰生股份	26,300	688,534.00	0.39
54	002078	太阳纸业	140,900	687,592.00	0.39
55	002001	新和成	32,500	686,725.00	0.39
56	600755	厦门国贸	85,800	682,110.00	0.38
57	600240	华业资本	67,967	681,029.34	0.38
58	002714	牧原股份	13,458	680,032.74	0.38
59	002142	宁波银行	45,890	678,254.20	0.38
60	601238	广汽集团	28,800	676,512.00	0.38
61	600093	禾嘉股份	54,500	676,345.00	0.38
62	002597	金禾实业	50,199	676,180.53	0.38
63	002460	赣锋锂业	20,200	675,690.00	0.38
64	002426	胜利精密	68,477	674,498.45	0.38
65	600415	小商品城	109,000	673,620.00	0.38
66	300251	光线传媒	58,200	672,792.00	0.38
67	300143	星河生物	28,800	672,480.00	0.38
68	601199	江南水务	86,400	672,192.00	0.38
69	000540	中天城投	107,800	671,594.00	0.38
70	300498	温氏股份	18,400	666,448.00	0.38
71	000807	云铝股份	101,100	662,205.00	0.37
72	600728	佳都科技	67,640	657,460.80	0.37
73	600419	天润乳业	12,200	657,458.00	0.37
74	600529	山东药玻	37,184	654,810.24	0.37

75	002466	天齐锂业	15,300	653,157.00	0.37
76	300025	华星创业	44,700	640,998.00	0.36
77	300330	华虹计通	34,500	614,445.00	0.35
78	000066	长城电脑	45,500	580,125.00	0.33
79	002079	苏州固锟	48,800	545,096.00	0.31
80	002027	分众传媒	32,900	543,179.00	0.31
81	300245	天玑科技	24,300	539,460.00	0.30
82	300002	神州泰岳	50,332	535,532.48	0.30
83	300042	朗科科技	15,661	533,883.49	0.30
84	000938	紫光股份	8,600	523,568.00	0.29
85	300174	元力股份	21,300	516,312.00	0.29
86	002195	二三四五	41,900	514,951.00	0.29
87	603019	中科曙光	12,898	513,598.36	0.29
88	002657	中科金财	9,200	505,448.00	0.28
89	600718	东软集团	27,480	503,433.60	0.28
90	000977	浪潮信息	21,349	500,634.05	0.28
91	600100	同方股份	33,400	499,664.00	0.28
92	002577	雷柏科技	9,598	489,977.90	0.28
93	002599	盛通股份	13,600	487,152.00	0.27
94	600850	华东电脑	16,630	477,114.70	0.27
95	002730	电光科技	28,600	477,048.00	0.27
96	300437	清水源	17,460	476,832.60	0.27
97	300405	科隆精化	10,350	476,203.50	0.27
98	300468	四方精创	6,000	454,020.00	0.26
99	600745	中茵股份	16,900	453,596.00	0.26
100	300354	东华测试	16,263	436,661.55	0.25
101	002696	百洋股份	22,700	434,478.00	0.24
102	300243	瑞丰高材	26,400	432,960.00	0.24
103	000586	汇源通信	19,600	431,200.00	0.24
104	002562	兄弟科技	16,226	430,962.56	0.24
105	002194	武汉凡谷	33,632	429,816.96	0.24
106	002666	德联集团	46,500	429,660.00	0.24
107	002530	丰东股份	15,180	429,594.00	0.24
108	002315	焦点科技	6,357	428,843.22	0.24
109	600522	中天科技	43,600	427,280.00	0.24
110	603010	万盛股份	19,280	426,473.60	0.24
111	002414	高德红外	15,800	426,126.00	0.24
112	300352	北信源	22,750	424,742.50	0.24
113	300007	汉威电子	15,200	424,384.00	0.24

114	000673	当代东方	33,800	423,514.00	0.24
115	002141	蓉胜超微	14,000	422,800.00	0.24
116	300392	腾信股份	15,600	422,448.00	0.24
117	300220	金运激光	11,800	422,440.00	0.24
118	000990	诚志股份	23,900	422,313.00	0.24
119	300379	东方通	5,300	421,244.00	0.24
120	300209	天泽信息	16,672	420,968.00	0.24
121	002322	理工环科	22,200	420,468.00	0.24
122	002401	中海科技	22,900	419,986.00	0.24
123	002011	盾安环境	37,200	419,616.00	0.24
124	300295	三六五网	12,900	419,250.00	0.24
125	300369	绿盟科技	9,900	418,869.00	0.24
126	600536	中国软件	16,800	418,656.00	0.24
127	600203	福日电子	30,300	418,140.00	0.24
128	000829	天音控股	31,300	417,855.00	0.24
129	002388	新亚制程	35,600	416,876.00	0.23
130	002356	赫美集团	16,442	416,640.28	0.23
131	300036	超图软件	17,000	416,500.00	0.23
132	002300	太阳电缆	42,700	415,471.00	0.23
133	300460	惠伦晶体	15,300	415,395.00	0.23
134	600327	大东方	46,554	415,261.68	0.23
135	600291	西水股份	20,800	413,296.00	0.23
136	002130	沃尔核材	25,700	413,256.00	0.23
137	600218	全柴动力	40,372	412,601.84	0.23
138	300315	掌趣科技	39,300	412,257.00	0.23
139	300301	长方集团	48,600	411,642.00	0.23
140	002253	川大智胜	11,000	410,850.00	0.23
141	000701	厦门信达	23,300	410,779.00	0.23
142	000980	金马股份	36,800	409,952.00	0.23
143	002368	太极股份	11,534	409,803.02	0.23
144	002279	久其软件	18,461	409,464.98	0.23
145	300360	炬华科技	18,080	409,150.40	0.23
146	600508	上海能源	44,100	408,807.00	0.23
147	601009	南京银行	43,500	408,465.00	0.23
148	300148	天舟文化	26,839	408,221.19	0.23
149	002082	栋梁新材	25,700	408,116.00	0.23
150	300081	恒信移动	24,000	408,000.00	0.23
151	600997	开滦股份	78,400	407,680.00	0.23
152	000411	英特集团	22,000	406,780.00	0.23

153	000521	美菱电器	67,400	406,422.00	0.23
154	300047	天源迪科	20,370	406,381.50	0.23
155	600487	亨通光电	32,300	406,334.00	0.23
156	002137	麦达数字	23,950	406,192.00	0.23
157	002017	东信和平	28,200	406,080.00	0.23
158	600345	长江通信	19,200	405,696.00	0.23
159	000716	黑芝麻	60,000	405,600.00	0.23
160	002660	茂硕电源	26,900	405,383.00	0.23
161	002184	海得控制	15,400	405,174.00	0.23
162	600844	丹化科技	62,700	405,042.00	0.23
163	300286	安科瑞	13,626	404,555.94	0.23
164	600644	乐山电力	49,402	404,108.36	0.23
165	002396	星网锐捷	20,500	403,850.00	0.23
166	002449	国星光电	30,400	403,408.00	0.23
167	002238	天威视讯	27,860	403,134.20	0.23
168	002119	康强电子	19,700	403,062.00	0.23
169	300275	梅安森	17,754	402,838.26	0.23
170	300241	瑞丰光电	24,390	402,678.90	0.23
171	600353	旭光股份	48,666	402,467.82	0.23
172	601137	博威合金	30,000	402,300.00	0.23
173	300139	晓程科技	27,247	400,803.37	0.23
174	600476	湘邮科技	14,200	400,298.00	0.23
175	300322	硕贝德	18,600	399,900.00	0.23
176	300062	中能电气	16,500	399,795.00	0.23
177	002015	霞客环保	41,600	398,528.00	0.22
178	300478	杭州高新	6,805	396,867.60	0.22
179	300051	三五互联	19,600	394,548.00	0.22
180	300331	苏大维格	13,800	393,438.00	0.22
181	000070	特发信息	15,000	393,300.00	0.22
182	300319	麦捷科技	13,600	391,952.00	0.22
183	000890	法尔胜	36,900	390,771.00	0.22
184	600747	大连控股	89,361	390,507.57	0.22
185	300102	乾照光电	42,600	386,808.00	0.22
186	300303	聚飞光电	40,500	385,155.00	0.22
187	600845	宝信软件	16,746	373,603.26	0.21
188	002093	国脉科技	29,400	364,854.00	0.21
189	600237	铜峰电子	46,600	354,626.00	0.20
190	002003	伟星股份	22,389	349,940.07	0.20
191	002681	奋达科技	19,986	337,363.68	0.19

192	300248	新开普	12,093	325,422.63	0.18
193	002624	完美环球	8,563	323,253.25	0.18
194	600114	东睦股份	19,064	320,465.84	0.18
195	002563	森马服饰	29,500	319,485.00	0.18
196	300500	苏州设计	3,759	319,477.41	0.18
197	000738	中航动控	11,695	308,748.00	0.17
198	300283	温州宏丰	32,777	307,448.26	0.17
199	600879	航天电子	19,500	303,810.00	0.17
200	002013	中航机电	22,524	303,623.52	0.17
201	600677	航天通信	16,300	300,735.00	0.17
202	300113	顺网科技	7,900	299,884.00	0.17
203	300419	浩丰科技	7,100	299,833.00	0.17
204	300458	全志科技	2,800	299,544.00	0.17
205	600765	中航重机	20,500	298,890.00	0.17
206	000901	航天科技	7,413	297,631.95	0.17
207	002527	新时达	18,777	296,676.60	0.17
208	002544	杰赛科技	9,216	295,557.12	0.17
209	300069	金利华电	9,200	295,320.00	0.17
210	300187	永清环保	22,000	294,800.00	0.17
211	600323	瀚蓝环境	23,230	294,788.70	0.17
212	002471	中超控股	47,700	293,355.00	0.17
213	002348	高乐股份	44,600	293,022.00	0.16
214	000032	深桑达 A	19,120	292,344.80	0.16
215	601999	出版传媒	30,700	292,264.00	0.16
216	300090	盛运环保	36,100	292,049.00	0.16
217	000598	兴蓉环境	55,300	291,984.00	0.16
218	600501	航天晨光	15,856	291,750.40	0.16
219	002028	思源电气	26,629	291,587.55	0.16
220	000063	中兴通讯	20,300	291,102.00	0.16
221	600855	航天长峰	9,300	291,090.00	0.16
222	600183	生益科技	31,400	291,078.00	0.16
223	300269	联建光电	11,200	290,976.00	0.16
224	300335	迪森股份	17,487	290,459.07	0.16
225	002504	弘高创意	12,000	290,400.00	0.16
226	300162	雷曼股份	13,200	290,268.00	0.16
227	002179	中航光电	6,700	290,244.00	0.16
228	002584	西陇科学	21,760	289,625.60	0.16
229	002463	沪电股份	54,850	289,608.00	0.16
230	002115	三维通信	25,200	289,548.00	0.16

231	002479	富春环保	25,775	289,453.25	0.16
232	002025	航天电器	11,700	288,873.00	0.16
233	000035	中国天楹	40,746	288,074.22	0.16
234	002616	长青集团	13,900	287,730.00	0.16
235	000682	东方电子	54,058	287,047.98	0.16
236	000601	韶能股份	27,401	286,340.45	0.16
237	300280	南通锻压	10,075	285,928.50	0.16
238	603568	伟明环保	12,300	284,130.00	0.16
239	002706	良信电器	10,300	280,572.00	0.16
240	300104	乐视网	5,200	275,132.00	0.15
241	000679	大连友谊	21,850	268,973.50	0.15
242	300022	吉峰农机	32,205	263,758.95	0.15
243	000333	美的集团	10,800	256,176.00	0.14
244	002174	游族网络	8,000	256,000.00	0.14
245	603011	合锻智能	22,000	254,320.00	0.14
246	002087	新野纺织	31,840	251,217.60	0.14
247	000567	海德股份	7,900	250,035.00	0.14
248	000719	大地传媒	23,400	247,104.00	0.14
249	002200	云投生态	12,924	243,746.64	0.14
250	600898	三联商社	19,224	240,492.24	0.14
251	000789	万年青	38,804	239,808.72	0.13
252	000548	湖南投资	30,802	239,023.52	0.13
253	002060	粤水电	34,757	238,780.59	0.13
254	300279	和晶科技	5,000	237,450.00	0.13
255	600706	曲江文旅	13,100	234,228.00	0.13
256	002456	欧菲光	7,900	233,050.00	0.13
257	002420	毅昌股份	23,900	207,930.00	0.12
258	600077	宋都股份	42,900	207,636.00	0.12
259	600615	丰华股份	11,600	207,524.00	0.12
260	600533	栖霞建设	41,000	206,640.00	0.12
261	002417	三元达	13,500	205,605.00	0.12
262	000554	泰山石油	23,900	205,540.00	0.12
263	000637	茂化实华	31,200	205,296.00	0.12
264	002652	扬子新材	15,900	204,792.00	0.12
265	002270	法因数控	12,601	204,640.24	0.12
266	600740	山西焦化	37,400	204,578.00	0.12
267	600389	江山股份	14,700	204,330.00	0.12
268	600502	安徽水利	27,600	203,412.00	0.11
269	002295	精艺股份	12,900	202,530.00	0.11

270	000900	现代投资	30,000	202,200.00	0.11
271	600781	辅仁药业	11,600	202,188.00	0.11
272	000153	丰原药业	19,600	202,076.00	0.11
273	600231	凌钢股份	85,100	201,687.00	0.11
274	300135	宝利国际	38,000	201,400.00	0.11
275	600657	信达地产	40,400	201,192.00	0.11
276	603167	渤海轮渡	20,200	200,990.00	0.11
277	603366	日出东方	23,900	200,760.00	0.11
278	001896	豫能控股	23,230	200,242.60	0.11
279	002661	克明面业	12,200	200,202.00	0.11
280	000420	吉林化纤	29,900	199,732.00	0.11
281	600658	电子城	19,000	196,270.00	0.11
282	002076	雪莱特	11,600	193,720.00	0.11
283	300400	劲拓股份	5,300	191,701.00	0.11
284	002633	申科股份	7,900	177,197.00	0.10
285	600776	东方通信	19,800	166,122.00	0.09
286	300371	汇中股份	4,600	165,508.00	0.09
287	300114	中航电测	5,300	157,940.00	0.09
288	603066	音飞储存	3,300	157,641.00	0.09
289	300121	阳谷华泰	10,900	149,221.00	0.08
290	002193	山东如意	8,700	142,767.00	0.08
291	300281	金明精机	9,600	142,464.00	0.08
292	000021	深科技	12,700	139,827.00	0.08
293	300366	创意信息	3,600	136,296.00	0.08
294	300420	五洋科技	2,100	131,964.00	0.07
295	600363	联创光电	7,300	130,013.00	0.07
296	603789	星光农机	4,400	129,536.00	0.07
297	002369	卓翼科技	11,400	128,250.00	0.07
298	300482	万孚生物	2,400	127,080.00	0.07
299	603558	健盛集团	6,700	126,429.00	0.07
300	002323	雅百特	9,700	126,294.00	0.07
301	300333	兆日科技	5,300	126,140.00	0.07
302	601007	金陵饭店	10,000	125,300.00	0.07
303	000628	高新发展	9,436	124,838.28	0.07
304	300175	朗源股份	13,700	123,848.00	0.07
305	300481	濮阳惠成	2,400	123,552.00	0.07
306	002095	生意宝	2,200	123,178.00	0.07
307	002770	科迪乳业	10,100	122,513.00	0.07
308	603022	新通联	5,900	122,366.00	0.07

309	603996	中新科技	4,000	122,040.00	0.07
310	600652	游久游戏	8,300	120,516.00	0.07
311	002765	蓝黛传动	4,562	120,208.70	0.07
312	000605	渤海股份	6,600	119,922.00	0.07
313	600071	凤凰光学	4,033	119,659.11	0.07
314	300455	康拓红外	5,300	118,932.00	0.07
315	603778	乾景园林	4,572	118,826.28	0.07
316	300215	电科院	9,201	118,508.88	0.07
317	000665	湖北广电	7,900	117,078.00	0.07
318	600360	华微电子	9,800	116,228.00	0.07
319	600038	中直股份	2,800	116,144.00	0.07
320	002579	中京电子	7,400	116,032.00	0.07
321	002111	威海广泰	4,400	115,676.00	0.07
322	600184	光电股份	5,100	115,464.00	0.06
323	002743	富煌钢构	8,000	115,360.00	0.06
324	600391	成发科技	3,000	115,350.00	0.06
325	600316	洪都航空	5,900	115,109.00	0.06
326	300480	光力科技	4,400	115,104.00	0.06
327	600372	中航电子	5,900	114,873.00	0.06
328	601126	四方股份	10,900	114,777.00	0.06
329	600289	亿阳信通	8,183	114,480.17	0.06
330	600893	中航动力	3,300	114,345.00	0.06
331	000768	中航飞机	5,800	114,202.00	0.06
332	300469	信息发展	900	114,048.00	0.06
333	603589	口子窖	3,101	112,287.21	0.06
334	603866	桃李面包	2,500	111,900.00	0.06
335	600271	航天信息	4,700	111,860.00	0.06
336	600498	烽火通信	4,600	111,688.00	0.06
337	600135	乐凯胶片	6,400	108,928.00	0.06
338	300452	山河药辅	2,200	107,184.00	0.06
339	300041	回天新材	7,400	106,486.00	0.06
340	600744	华银电力	19,300	105,957.00	0.06
341	002745	木林森	3,000	101,970.00	0.06
342	002792	通宇通讯	1,700	101,660.00	0.06
343	300364	中文在线	1,896	98,592.00	0.06
344	002022	科华生物	4,590	97,812.90	0.06
345	600521	华海药业	4,019	97,742.08	0.06
346	000430	张家界	8,500	96,475.00	0.05
347	000822	山东海化	18,600	94,302.00	0.05

348	002761	多喜爱	2,242	90,531.96	0.05
349	600681	百川能源	8,290	89,863.60	0.05
350	002604	龙力生物	8,300	89,557.00	0.05
351	002650	加加食品	12,509	88,938.99	0.05
352	002771	真视通	833	87,423.35	0.05
353	600698	湖南天雁	14,750	87,320.00	0.05
354	600975	新五丰	9,400	86,010.00	0.05
355	601611	中国核建	4,033	84,370.36	0.05
356	601020	华钰矿业	2,914	83,515.24	0.05
357	300453	三鑫医疗	3,157	82,681.83	0.05
358	603969	银龙股份	6,199	82,632.67	0.05
359	000663	永安林业	6,400	82,432.00	0.05
360	002514	宝馨科技	6,700	81,874.00	0.05
361	002474	榕基软件	4,300	81,270.00	0.05
362	000561	烽火电子	7,300	81,176.00	0.05
363	300192	科斯伍德	6,269	79,804.37	0.04
364	002680	长生生物	1,900	78,926.00	0.04
365	603126	中材节能	7,100	78,242.00	0.04
366	600981	汇鸿集团	9,232	77,825.76	0.04
367	002757	南兴装备	1,799	73,039.40	0.04
368	300421	力星股份	2,300	71,829.00	0.04
369	603131	上海沪工	1,179	71,565.30	0.04
370	300483	沃施股份	1,100	66,286.00	0.04
371	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.04
372	300431	暴风集团	800	58,000.00	0.03
373	601127	小康股份	2,170	51,797.90	0.03
374	600052	浙江广厦	7,100	48,848.00	0.03
375	000753	漳州发展	10,900	48,723.00	0.03
376	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.03
377	300218	安利股份	2,800	43,092.00	0.02
378	002705	新宝股份	2,700	42,174.00	0.02
379	300518	盛讯达	620	29,047.00	0.02
380	002802	洪汇新材	1,508	22,740.64	0.01
381	603909	合诚股份	1,022	18,784.36	0.01
382	603958	哈森股份	1,164	16,878.00	0.01
383	601966	玲珑轮胎	1,205	15,640.90	0.01
384	603016	新宏泰	1,264	10,731.36	0.01
385	300520	科大国创	926	9,306.30	0.01
386	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%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	000698	沈阳化工	12,449,175.13	5.38
2	600529	山东药玻	12,248,509.62	5.30
3	000906	物产中拓	10,869,908.38	4.70
4	600757	长江传媒	9,948,502.45	4.30
5	600203	福日电子	9,173,280.18	3.97
6	002394	联发股份	9,067,715.45	3.92
7	601999	出版传媒	9,064,058.06	3.92
8	002203	海亮股份	8,914,809.68	3.86
9	000407	胜利股份	8,643,576.86	3.74
10	000716	黑芝麻	8,498,860.08	3.68
11	002417	三元达	8,403,695.98	3.63
12	600242	中昌海运	8,393,326.04	3.63
13	601009	南京银行	8,357,394.16	3.61
14	002519	银河电子	8,271,610.30	3.58
15	600657	信达地产	8,050,619.90	3.48
16	000719	大地传媒	7,952,330.10	3.44
17	300365	恒华科技	7,674,631.28	3.32
18	002238	天威视讯	7,548,739.04	3.26
19	000544	中原环保	7,462,656.46	3.23
20	002206	海利得	7,433,082.74	3.21
21	600686	金龙汽车	7,275,711.16	3.15
22	000411	英特集团	6,858,712.06	2.97
23	600295	鄂尔多斯	6,848,185.62	2.96
24	600533	栖霞建设	6,770,915.94	2.93
25	600644	乐山电力	6,697,953.63	2.90
26	000665	湖北广电	6,695,607.82	2.90
27	000952	广济药业	6,645,150.95	2.87
28	000711	京蓝科技	6,639,425.00	2.87
29	000890	法尔胜	6,577,020.45	2.84

30	600508	上海能源	6,523,713.44	2.82
31	002060	粤水电	6,412,889.26	2.77
32	000990	诚志股份	6,374,392.20	2.76
33	603003	龙宇燃油	6,303,978.84	2.73
34	002171	楚江新材	6,256,469.60	2.71
35	002719	麦趣尔	6,251,928.80	2.70
36	000756	新华制药	6,226,118.91	2.69
37	002443	金洲管道	6,183,012.91	2.67
38	300218	安利股份	6,108,635.86	2.64
39	600475	华光股份	6,106,669.16	2.64
40	600597	光明乳业	6,087,337.10	2.63
41	600387	海越股份	5,978,757.15	2.59
42	000586	汇源通信	5,933,201.19	2.57
43	600566	济川药业	5,877,364.79	2.54
44	000900	现代投资	5,847,832.70	2.53
45	600983	惠而浦	5,810,013.96	2.51
46	002295	精艺股份	5,787,896.00	2.50
47	300214	日科化学	5,774,816.81	2.50
48	600531	豫光金铅	5,698,308.64	2.46
49	002187	广百股份	5,672,990.79	2.45
50	600681	百川能源	5,582,511.61	2.41
51	600683	京投发展	5,567,106.16	2.41
52	300143	星河生物	5,559,116.62	2.40
53	002302	西部建设	5,557,413.89	2.40
54	002401	中海科技	5,557,312.00	2.40
55	002743	富煌钢构	5,548,644.00	2.40
56	600853	龙建股份	5,463,329.19	2.36
57	002377	国创高新	5,451,090.26	2.36
58	603167	渤海轮渡	5,438,639.92	2.35
59	000521	美菱电器	5,436,881.25	2.35
60	002313	日海通讯	5,411,047.04	2.34
61	002435	长江润发	5,360,741.76	2.32
62	600595	中孚实业	5,345,197.51	2.31
63	600455	博通股份	5,335,066.22	2.31
64	300235	方直科技	5,323,949.76	2.30
65	600714	金瑞矿业	5,276,089.24	2.28

66	300319	麦捷科技	5,240,266.10	2.27
67	000429	粤高速 A	5,231,355.36	2.26
68	000708	大冶特钢	5,222,732.55	2.26
69	601137	博威合金	5,172,657.35	2.24
70	000966	长源电力	5,133,885.00	2.22
71	002357	富临运业	5,114,295.45	2.21
72	300158	振东制药	4,982,280.00	2.15
73	001896	豫能控股	4,961,760.08	2.15
74	300277	海联讯	4,894,426.00	2.12
75	600798	宁波海运	4,871,113.77	2.11
76	600327	大东方	4,869,633.73	2.11
77	000408	*ST 金源	4,843,220.49	2.09
78	000637	茂化实华	4,840,955.60	2.09
79	002370	亚太药业	4,833,363.15	2.09
80	600888	新疆众和	4,800,779.49	2.08
81	002478	常宝股份	4,775,631.00	2.07
82	600167	联美控股	4,763,080.00	2.06
83	600064	南京高科	4,715,851.25	2.04
84	600984	建设机械	4,687,022.97	2.03
85	300349	金卡股份	4,676,202.35	2.02
86	002599	盛通股份	4,664,311.80	2.02
87	002090	金智科技	4,661,405.72	2.02
88	002087	新野纺织	4,646,284.80	2.01

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%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	000698	沈阳化工	12,530,133.35	5.42
2	600529	山东药玻	11,500,890.41	4.97
3	000906	物产中拓	10,687,530.00	4.62
4	600686	金龙汽车	10,517,685.65	4.55
5	600757	长江传媒	10,262,598.49	4.44
6	600533	栖霞建设	10,047,725.22	4.35
7	000716	黑芝麻	9,897,503.56	4.28
8	000544	中原环保	9,883,971.92	4.27

9	600203	福日电子	9,864,868.08	4.27
10	600508	上海能源	9,582,733.42	4.14
11	002394	联发股份	9,035,286.40	3.91
12	600566	济川药业	8,956,330.45	3.87
13	600531	豫光金铅	8,772,907.22	3.79
14	600681	百川能源	8,762,879.05	3.79
15	000719	大地传媒	8,730,292.57	3.78
16	000407	胜利股份	8,695,127.52	3.76
17	600853	龙建股份	8,673,700.19	3.75
18	002238	天威视讯	8,653,147.14	3.74
19	002203	海亮股份	8,593,868.74	3.72
20	600295	鄂尔多斯	8,586,177.51	3.71
21	002519	银河电子	8,415,840.38	3.64
22	002295	精艺股份	8,330,997.08	3.60
23	603003	龙宇燃油	8,145,631.04	3.52
24	000756	新华制药	8,138,191.22	3.52
25	601999	出版传媒	8,135,644.46	3.52
26	601028	玉龙股份	8,122,553.78	3.51
27	300365	恒华科技	8,067,680.69	3.49
28	600167	联美控股	8,014,371.83	3.47
29	600714	金瑞矿业	7,986,868.47	3.45
30	300158	振东制药	7,978,997.43	3.45
31	603167	渤海轮渡	7,870,032.67	3.40
32	601009	南京银行	7,859,239.39	3.40
33	600888	新疆众和	7,859,174.60	3.40
34	000708	大冶特钢	7,817,931.24	3.38
35	002417	三元达	7,718,928.60	3.34
36	600657	信达地产	7,616,219.97	3.29
37	002206	海利得	7,615,207.83	3.29
38	002302	西部建设	7,416,000.57	3.21
39	600798	宁波海运	7,390,114.03	3.20
40	000966	长源电力	7,371,423.97	3.19
41	000900	现代投资	7,193,063.16	3.11
42	000890	法尔胜	7,138,944.20	3.09
43	000711	京蓝科技	6,988,851.94	3.02
44	600683	京投发展	6,822,132.10	2.95
45	002171	楚江新材	6,799,843.45	2.94
46	000411	英特集团	6,795,773.16	2.94

47	000665	湖北广电	6,580,496.12	2.85
48	002478	常宝股份	6,513,824.56	2.82
49	600242	中昌海运	6,491,490.16	2.81
50	300143	星河生物	6,474,455.51	2.80
51	000990	诚志股份	6,431,222.89	2.78
52	002313	日海通讯	6,377,802.68	2.76
53	600983	惠而浦	6,344,757.84	2.74
54	600387	海越股份	6,324,617.87	2.74
55	600644	乐山电力	6,278,920.84	2.72
56	002719	麦趣尔	6,232,162.74	2.70
57	600419	天润乳业	6,166,826.33	2.67
58	002054	德美化工	6,125,703.02	2.65
59	002159	三特索道	6,112,907.63	2.64
60	300218	安利股份	6,099,256.88	2.64
61	002060	粤水电	6,073,677.59	2.63
62	000586	汇源通信	6,021,612.81	2.60
63	600597	光明乳业	5,992,548.43	2.59
64	001896	豫能控股	5,928,980.80	2.56
65	002443	金洲管道	5,923,316.18	2.56
66	002599	盛通股份	5,854,295.21	2.53
67	002187	广百股份	5,839,759.11	2.53
68	300214	日科化学	5,824,622.65	2.52
69	600561	江西长运	5,767,716.87	2.49
70	000628	高新发展	5,747,436.18	2.49
71	002435	长江润发	5,620,736.44	2.43
72	002616	长青集团	5,602,007.63	2.42
73	002377	国创高新	5,597,741.77	2.42
74	002357	富临运业	5,587,493.74	2.42
75	000429	粤高速 A	5,517,259.01	2.39
76	002743	富煌钢构	5,380,076.20	2.33
77	002210	飞马国际	5,374,651.70	2.32
78	002090	金智科技	5,141,146.20	2.22
79	600475	华光股份	5,104,439.01	2.21
80	000408	*ST 金源	5,097,260.00	2.20
81	002370	亚太药业	5,065,426.97	2.19
82	002401	中海科技	5,056,134.89	2.19
83	300319	麦捷科技	4,915,094.19	2.13
84	300277	海联讯	4,871,554.84	2.11

85	600418	江淮汽车	4,836,656.91	2.09
86	000404	华意压缩	4,735,748.40	2.05
87	601020	华钰矿业	4,686,719.62	2.03
88	002057	中钢天源	4,678,389.87	2.02
89	000637	茂化实华	4,638,345.46	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,695,923,679.86
卖出股票收入（成交）总额	1,722,669,941.29

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1607	IC1607	4	4,834,720.00	135,093.33	本基金利用股指期货进行多头套保，一方面是为了应对由于基金的大额赎回而带来的对基金净值的影响，另一

					方面因为股指期货长期折价，主力股指期货当月到期后折价会收敛，可以享受折价带来的超额收益。
公允价值变动总额合计（元）					135,093.33
股指期货投资本期收益（元）					34,946.67
股指期货投资本期公允价值变动（元）					135,093.33

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，本基金少量参与股指期货交易，主要是用来调节组合头寸。

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

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未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	1,172,657.48
2	应收证券清算款	768,754.62
3	应收股利	-
4	应收利息	4,223.21
5	应收申购款	18,670.79

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,964,306.10

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600734	实达集团	3,438,519.00	1.94	重大事项停牌
2	600455	博通股份	3,103,387.56	1.75	重大事项停牌
3	300385	雪浪环境	2,527,433.52	1.42	重大事项停牌
4	000498	山东路桥	1,919,232.00	1.08	重大事项停牌
5	000551	创元科技	1,887,876.18	1.06	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,185	83,343.43	1,590,929.54	0.87%	180,514,465.16	99.13%

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	39,057.35	0.0214%

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（2015年11月10日）基金份额总额	388,036,526.34
本报告期期初基金份额总额	222,130,970.75
本报告期基金总申购份额	5,794,102.44
减：本报告期基金总赎回份额	45,819,678.49
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	182,105,394.70

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人在本报告期内重大人事变动情况：公司于2016年1月27日以书面方式召开2016年第一次股东会会议，审议同意龚六堂先生辞去公司第一届董事会独立董事职务；任命陈耿先生担任公司第一届董事会独立董事职务，任期为：原独立董事龚六堂先生任期的剩余期限。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无涉及管理人、托管人及高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	
万联证券	2	1,795,305,007.58	52.53%	1,671,969.76	59.90%	-
联讯证券	2	642,699,027.03	18.80%	598,546.60	21.44%	-
川财证券	2	599,529,509.87	17.54%	318,529.77	11.41%	-
申万宏源	2	210,974,087.53	6.17%	112,090.80	4.02%	-
中信证券	2	169,479,487.95	4.96%	90,044.97	3.23%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
万联证券	459,641.32	100.00%	75,000,000.00	100.00%	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

2、本公司租用券商交易单元的程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单经公募基金业务投资决策委员会或专户业务投资决策委员会审批同意后与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签订协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。监察稽核部对委托协议的合法合规性进行审查。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况

新增联讯证券股份有限公司上海交易单元 1 个、深圳交易单元 1 个。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况

无。

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	九泰基金管理有限公司关于交易所指数发生不可恢复熔断导致我公司部分基金业务办理时间调整的公告	公司网站	2016 年 1 月 5 日
2	九泰基金管理有限公司关于法定代表人变更的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 6 日
3	九泰基金管理有限公司关于增加德邦证券公司为九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 7 日
4	九泰基金管理有限公司关于交易所指数发生不可恢复熔断导致我公司部分基金业务	公司网站	2016 年 1 月 7 日

	办理时间调整的公告		
5	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 8 日
6	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 14 日
7	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司作为我公司部分开放式基金销售机构并开通基金定投、转换业务及参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 26 日
8	关于我公司所管理基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 1 月 27 日
9	关于增加上海汇付金融服务有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
10	关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
11	关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
12	关于增加陆金所资管公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
13	关于增加珠海盈米财富管理有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 4 日
14	关于九泰基金管理有限公司电子直销交易系统维护的公告	公司网站	2016 年 3 月 14 日
15	关于增加九泰基金销售（北京）有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 3 月 17 日

	公告		
16	关于增加深圳富济财富管理有限公司作为 我公司开放式基金销售机构并开通基金定 投、转换业务及参与费率优惠活动的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 3 月 18 日
17	九泰基金管理有限公司关于九泰久稳保本 混合型证券投资基金增加销售机构的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 5 日
18	关于增加首创证券有限责任公司为我公司 所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 6 日
19	关于增加首创证券有限责任公司为我公司 所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 11 日
20	关于增加华融证券股份有限公司为我公司 所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 12 日
21	关于增加华融证券股份有限公司为我公司 所管理部分基金销售机构的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 14 日
22	关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公 司为我公司所管理部分开放式基金销售机 构的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 18 日
23	九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投 资基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 20 日
24	关于增加大泰金石投资管理有限公司作为 我公司部分基金销售机构并参与费率优惠 活动的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 22 日
25	关于增加湘财证券投资管理有限公司作为 我公司部分基金销售机构并参与费率优惠 活动的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 4 月 22 日
26	关于增加北京汇成基金销售有限公司作为 我公司部分基金销售机构并参与费率优惠 活动的公告	证监会指定报 刊和公司网站	2016 年 5 月 9 日
27	关于增加乾道金融公司为我公司部分基金	证监会指定报	2016 年 5 月 9 日

	销售机构并参与费率优惠活动的公告	刊和公司网站	
28	九泰基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 14 日
29	关于九泰基金管理有限公司所管理部分开放式基金开通电子直销定期定额申购业务及费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 16 日
30	关于增加上海大智慧财富管理有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 19 日
31	关于增加深圳金斧子作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 19 日
32	关于九泰基金管理有限公司系统维护暂停相关服务的公告	公司网站	2016 年 5 月 20 日
33	关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 5 月 27 日
34	关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为我公司所管理基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 2 日
35	关于增加北京恒天明泽基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 7 日
36	关于增加大泰金石投资管理有限公司作为我公司部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 16 日
37	关于增加湘财证券股份有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日

38	九泰基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
39	九泰基金管理有限公司关于调整开户证件类型公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
40	九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	公司网站	2016 年 6 月 23 日
41	九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新摘要	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 23 日
42	关于增加深圳前海京西票号基金销售有限公司为我公司所管理部分开放式基金销售机构的公告	证监会指定报刊和公司网站	2016 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本报期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件
- 2、《九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《九泰久盛量化先锋灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

九泰基金管理有限公司
2016 年 8 月 26 日