

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资 基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十六日

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
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
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
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	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	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	46
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
8 基金份额持有人信息	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.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	48
9 开放式基金份额变动.....	48
10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
11 备查文件目录.....	53
11.1 备查文件目录.....	53
11.2 存放地点.....	53
11.3 查阅方式.....	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	广发套利
基金主代码	000992
交易代码	000992
基金运作方式	契约型开放式，本基金以定期开放方式运作契约型开放式，本基金以定期开放方式运作
基金合同生效日	2015 年 2 月 6 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	823,235,025.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期稳定的绝对收益。在有效控制系统性风险的基础上，通过量化模型构建市场中性投资组合，对冲市场系统风险，力争实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金主要采用对冲套利的投资策略，坚持模型驱动的纪律性，运用基金管理人自主研发的量化多因素选股模型，选取具备投资价值的股票构建投资组合，并做空股指期货进行对冲操作，有效的规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益，力争实现基金资产长期稳健的增值。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款税后收益率。
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

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		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	洪渊
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	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	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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	12,937,555.56
本期利润	8,501,433.92
加权平均基金份额本期利润	0.0065
本期加权平均净值利润率	0.57%
本期基金份额净值增长率	0.53%
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	112,127,381.81
期末可供分配基金份额利润	0.1362
期末基金资产净值	935,362,407.34
期末基金份额净值	1.136
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	13.60%

注：（1）上述基金业绩指标不包括持有人认购和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）。

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	0.09%	0.04%	0.13%	0.00%	-0.04%	0.04%
过去三个月	0.53%	0.05%	0.38%	0.00%	0.15%	0.05%
过去六个月	0.53%	0.14%	0.76%	0.00%	-0.23%	0.14%
过去一年	1.97%	0.20%	1.64%	0.00%	0.33%	0.20%
自基金合同生效起至今	13.60%	0.31%	2.63%	0.00%	10.97%	0.31%

注：业绩比较基准：1 年期银行定期存款税后收益率。

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

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015 年 2 月 6 日至 2016 年 6 月 30 日）



注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 25 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理九十八只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起

式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合

型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
魏军	本基金的基金经理；量化投资部副总经理	2016-05-10	-	8 年	男，中国籍，数量经济学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2008 年 7 月至 2010 年 10 月任广发基金管理有限公司量化研究员，2010 年 3 月 11 日起至 2011 年 10 月 18 日任广发沪深 300 指数基金和广发中证 500 指数基金的基金经理助理，2011 年 10 月 19 日至 2016 年 1 月 17 日任广发中小板 300ETF 及广发中小板 300 联接基金的基金经理，2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日任广发深证 100 指数分级基金的基金经理，2016 年 1 月 28 日至 2016 年 5 月 29 日任另类投资部副总经理，2016 年 5 月 10 日起任广发套利混合基金的基金经理，2016 年 5 月 30 日起任量化投资部副总经理。
钟伟	本基金的基金经理；广发中债金融债指数基金的基金经理	2015-02-06	2016-05-10	7 年	男，中国籍，数学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2009 年 7 月至 2013 年 11 月先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员，2013 年 11 月 7 日至 2015 年 8 月 8 日任广发中债金融债指数基金的基金经理，2015 年 2 月 6 日至 2016 年 5 月 9 日任广发对冲套利混合基金的基金经理。

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信

用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 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

今年上半年，期货合约继续保持贴水状态，但贴水幅度较去年明显收窄，贴水收敛时间也有所提前，期货的流动性较去年底明显改善。

在基金操作上，上半年适当降低了对冲策略的仓位，并根据市场的变化，灵活的调整了仓位。但由于基差持续贴水，做空股指期货的基差收益为负，使得多因子模型的 alpha 收益被蚕蚀。

从运作结果来看，同期沪深 300 下跌 15.47%，相比市场的下跌，本报告期内基金净值没有

发生亏，净值增长率符合预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，期货市场大概率会维持负基差的状态。但期货市场的成交量和人气在逐步恢复中，投资界也有声音在呼吁为股指期货松绑。如果期指放开，对中性对冲策略无疑将是一个机会。另一方面，我们也在不断改进我们的量化模型，寻找增厚收益的途径。

我们会密切关注市场的变化，在市场变化中寻找合适的操作时机，在控制风险的前提下尽可能的获取绝对收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关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

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

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，本基金托管人在对广发对冲套利定期开放混合型发起式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，广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发对冲套利定期开放混合型发起式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，广发对冲套利定期开放混合型发起式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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金 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：广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

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	3,781,773.37	252,549,315.29
结算备付金		29,883,395.81	273,776,588.02
存出保证金		19,214,793.32	91,615,502.61

交易性金融资产	6.4.7.2	93,993,148.68	472,621,857.04
其中：股票投资		92,082,987.08	438,522,483.24
基金投资		-	-
债券投资		1,910,161.60	34,099,373.80
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	791,000,000.00	785,962,533.94
应收证券清算款		188,490.60	78,115,822.97
应收利息	6.4.7.5	60,475.34	1,140,954.54
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		938,122,077.12	1,955,782,574.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	17,783,780.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		766,159.48	1,638,756.72
应付托管费		153,231.87	327,751.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,646,816.93	1,139,208.97
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	193,461.50	315,000.01
负债合计		2,759,669.78	21,204,497.76
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	823,235,025.53	1,712,655,632.15
未分配利润	6.4.7.1 0	112,127,381.81	221,922,444.50
所有者权益合计		935,362,407.34	1,934,578,076.65
负债和所有者权益总计		938,122,077.12	1,955,782,574.41

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.136 元，基金份额总额 823,235,025.53 份。

6.2 利润表

会计主体：广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 6 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		22,879,326.69	117,042,632.76
1. 利息收入		15,814,894.86	3,522,785.11
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	7,641,524.81	2,848,283.69
债券利息收入		298,344.00	5,024.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,875,026.05	669,476.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,275,471.33	92,247,337.96
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-22,154,941.17	367,109,262.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	1,108,299.67	2,600.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	30,849,903.21	-277,388,437.96
股利收益	6.4.7.1 5	472,209.62	2,523,913.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-4,436,121.64	20,099,336.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	1,225,082.14	1,173,173.37
减：二、费用		14,377,892.77	15,168,421.86
1. 管理人报酬		8,300,368.23	7,144,474.69
2. 托管费		1,495,762.85	820,640.15
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	4,357,333.53	7,041,301.70
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6. 4. 7. 1 9	224, 428. 16	162, 005. 32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8, 501, 433. 92	101, 874, 210. 90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8, 501, 433. 92	101, 874, 210. 90

注：本基金合同生效日为 2015 年 2 月 6 日，上年度可比期间不完整。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1, 712, 655, 632. 15	221, 922, 444. 50	1, 934, 578, 076. 65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8, 501, 433. 92	8, 501, 433. 92
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）	-889, 420, 606. 62	-118, 296, 496. 61	-1, 007, 717, 103. 23
其中：1. 基金申购款	7, 522, 168. 80	995, 345. 65	8, 517, 514. 45
2. 基金赎回款	-896, 942, 775. 42	-119, 291, 842. 26	-1, 016, 234, 617. 68
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）	823, 235, 025. 53	112, 127, 381. 81	935, 362, 407. 34
项目	上年度可比期间 2015 年 2 月 6 日（基金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1, 126, 397, 761. 48	-	1, 126, 397, 761. 48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101, 874, 210. 90	101, 874, 210. 90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	-352, 446, 088. 57	-13, 429, 340. 46	-365, 875, 429. 03

值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	98,844,236.33	3,995,119.91	102,839,356.24
2. 基金赎回款	-451,290,324.90	-17,424,460.37	-468,714,785.27
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）	773,951,672.91	88,444,870.44	862,396,543.35

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2014]1406 号文《关于准予广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》批准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2015 年 2 月 6 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 1 月 21 日至 2015 年 2 月 3 日，本基金为契约型开放式混合型基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币 1,126,397,761.48 元，有效认购户数为 8,492 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 98,066.25 元，折合基金份额 98,066.25 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。基金合同于 2015 年 2 月 6 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,126,397,761.48 份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债等）、权证、货币市场工具、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。本基金业绩比较基准为：1 年期银行定

期存款税后收益率。

本基金的财务报表于 2016 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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颁布的企业会计准则及相关规定(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 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间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]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《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》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. 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

免征营业税和增值税。

3. 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。

4. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，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。

5. 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，暂不缴纳企业所得税。

6. 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。

7. 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	3,781,773.37
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,781,773.37

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	90,865,368.29	92,082,987.08	1,217,618.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,810,000.00	1,910,161.60
	银行间市场	-	-

	合计	1,810,000.00	1,910,161.60	100,161.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	92,675,368.29	93,993,148.68	1,317,780.39

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-83,294,880.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-83,294,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-83,294,880.00	-	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位： 手)	合约市值	公允价值变动
IF1608	IF1608	-22	-20,292,360.00	-455,940.00
IF1609	IF1609	-69	-63,002,520.00	-1,214,340.00
总额合计			-83,294,880.00	-1,670,280.00
减：可抵销期货暂收款				-1,670,280.00
股指期货投资净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

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
交易所买入返售金融资产	791,000,000.00	-
银行间买入返售金融资产	-	-
合计	791,000,000.00	-

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	751.67
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	697.77
应收结算备付金利息	57,303.93
应收债券利息	1,721.97
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	-
合计	60,475.34

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	1,641,434.79
银行间市场应付交易费用	5,382.14
合计	1,646,816.93

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	-
预提费用	193,461.50
合计	193,461.50

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	1,712,655,632.15	1,712,655,632.15
本期申购	7,522,168.80	7,522,168.80
本期赎回（以“-”号填列）	-896,942,775.42	-896,942,775.42
本期末	823,235,025.53	823,235,025.53

注：本期申购含红利再投资和转换转入份（金）额，本期赎回含转换转出份（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	230,373,151.11	-8,450,706.61	221,922,444.50

本期利润	12,937,555.56	-4,436,121.64	8,501,433.92
本期基金份额交易产生的变动数	-125,245,904.33	6,949,407.72	-118,296,496.61
其中：基金申购款	1,066,865.04	-71,519.39	995,345.65
基金赎回款	-126,312,769.37	7,020,927.11	-119,291,842.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	118,064,802.34	-5,937,420.53	112,127,381.81

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	484,522.09	
定期存款利息收入	6,205,458.34	
其他存款利息收入	15,390.47	
结算备付金利息收入	936,153.91	
其他	-	
合计	7,641,524.81	

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	2,648,447,456.50	
减：卖出股票成本总额	2,670,602,397.67	
买卖股票差价收入	-22,154,941.17	

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	43,042,048.02	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,248,080.00	
减：应收利息总额	685,668.35	
买卖债券差价收入	1,108,299.67	

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
股指期货投资收益	30,849,903.21	

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	472,209.62
基金投资产生的股利收益	-
合计	472,209.62

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	6,232,461.57
——股票投资	6,672,593.77
——债券投资	-440,132.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-10,668,583.21
——权证投资	-
——股指期货投资	-10,668,583.21
4. 其他	-
合计	-4,436,121.64

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	1,177,188.54
手续费返还	-
基金转换费收入	42,893.59
印花税返还	-
其他	5,000.01
合计	1,225,082.14

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	4,205,977.89
银行间市场交易费用	225.00
期货交易费用	151,130.64
合计	4,357,333.53

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	39,781.56	
信息披露费	149,179.94	
银行汇划费	20,321.66	
账户维护费	15,000.00	
其他	145.00	
合计	224,428.16	

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
广发期货有限公司	基金管理人母公司的全资子公司

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年2月6日（基金合同生效日） 至2015年6月30日

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	509,031,000.00	54.49%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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2月6日（基金合同生 效日）至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,300,368.23	7,144,474.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,558,972.19	2,535,589.01

注：1. 本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。基本管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的基本管理费每日计算，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基本管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2. 本基金的附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日按“新高法原则”提取超额收益的 10%，即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者。附加管理费的计算方法如下：

$$\text{附加管理费} = [P(a) - P(h)] \times 10\% \times S(a)$$

P(a) 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值 1

P(h) 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，其中首次封闭期的 P(h) 为 1

S(a) 为提取评价日的基金份额

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。由基金管理人向基金托管人发送基金附加管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等，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2月6日（基金合同生 效日）至2015年6月30日
----	--------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	1,495,762.85	820,640.15
----------------	--------------	------------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联交易对手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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年2月6日（基金合同生效日）至2015年6月30日
基金合同生效日(2015年2月6日)持有的基金份额	-	10,000,200.02
期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.21%	1.29%

注：基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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2月6日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,781,773.37	484,522.09	679,083,911.66	636,009.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016-06-15	2016-07-01	新债流通受限	100.00	100.00	8,860.00	886,000.00	886,000.00	-

注：截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限股票及权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000415	渤海金控	2016-02-01	重大事项停牌	6.82	2016-08-11	7.50	51,600.00	384,617.57	351,912.00	-
000651	格力电器	2016-02-22	重大事项停牌	22.07	-	-	65,400.00	1,264,473.80	1,443,378.00	-
600005	武钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	2.76	-	-	52,000.00	147,837.00	143,520.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项停牌	4.90	-	-	28,800.00	145,740.00	141,120.00	-
600121	郑州煤电	2016-06-17	重大事项停牌	4.80	2016-07-01	5.05	9,200.00	42,896.00	44,160.00	-
600295	鄂尔多斯	2016-06-30	重大事项停牌	7.89	2016-07-14	8.46	11,100.00	86,669.15	87,579.00	-
600649	城投控股	2016-06-20	重大事项停牌	14.36	-	-	24,900.00	371,332.08	357,564.00	-
600860	京城股份	2016-06-27	重大事项停牌	8.43	2016-07-05	8.85	9,800.00	91,387.17	82,614.00	-

603606	东方电缆	2016-06-22	重大事项停牌	13.85	2016-07-05	15.13	6,700.00	85,609.00	92,795.00	-
--------	------	------------	--------	-------	------------	-------	----------	-----------	-----------	---

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	30,039,000.00
合计	-	30,039,000.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2. 以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券及同业存单。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	-	4,060,373.80
AAA 以下	1,910,161.60	-
未评级	-	-
合计	1,910,161.60	4,060,373.80

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2. 以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债及央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大的风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	3,781,773.37	-	-	-	3,781,773.37
结算备付金	29,883,395.81	-	-	-	29,883,395.81
存出保证金	19,214,793.32	-	-	-	19,214,793.32
交易性金融资产	886,000.00	1,024,161.60	-	92,082,987.08	93,993,148.68
买入返售金融资产	791,000,000.00	-	-	-	791,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	188,490.60	188,490.60
应收利息	-	-	-	60,475.34	60,475.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	844,765,962.50	1,024,161.60	-	92,331,953.02	938,122,077.12
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	766,159.48	766,159.48
应付托管费	-	-	-	153,231.87	153,231.87
应付交易费用	-	-	-	1,646,816.93	1,646,816.93
其他负债	-	-	-	193,461.50	193,461.50
负债总计	-	-	-	2,759,669.78	2,759,669.78
利率敏感度缺口	844,765,962.50	1,024,161.60	-	89,572,283.24	935,362,407.34
上年度末					
2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	252,549,315.29	-	-	-	252,549,315.29
结算备付金	273,776,588.02	-	-	-	273,776,588.02
存出保证金	91,615,502.61	-	-	-	91,615,502.61
交易性金融资产	30,039,000.00	2,008,001.80	2,052,372.00	438,522,483.24	472,621,857.04
买入返售金融资产	785,962,533.94	-	-	-	785,962,533.94

应收证券清算款	-	-	-	78,115,822.97	78,115,822.97
应收利息	-	-	-	1,140,954.54	1,140,954.54
资产总计	1,433,942,939.86	2,008,001.80	2,052,372.00	517,779,260.75	1,955,782,574.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	17,783,780.70	17,783,780.70
应付管理人报酬	-	-	-	1,638,756.72	1,638,756.72
应付托管费	-	-	-	327,751.36	327,751.36
应付交易费用	-	-	-	1,139,208.97	1,139,208.97
其他负债	-	-	-	315,000.01	315,000.01
负债总计	-	-	-	21,204,497.76	21,204,497.76
利率敏感度缺口	1,433,942,939.86	2,008,001.80	2,052,372.00	496,574,762.99	1,934,578,076.65

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2016年6月30日	2015年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-24,620.65	-38,266.91
	市场利率下降 25 个基点	24,620.65	38,364.65

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型 (VAR) 等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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	上年度末
----	-----	------

	2016 年 6 月 30 日		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	92,082,987.08	9.84	438,522,483.24	22.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,910,161.60	0.20	34,099,373.80	1.76
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	93,993,148.68	10.05	472,621,857.04	24.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金针对股票构建投资组合，并做空股指期货进行对冲操作，因此无重大其他价格风险。

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

(1) 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应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

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级的余额为 89,338,345.08 元，属于第二层级的余额为 3,768,803.60 元，属于第三层级的余额为 886,000.00 元(2015 年 12 月 31 日：第一层级 436,812,872.29 元，第二层级 35,761,384.75 元，第三层级 47,600.00 元)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(iv)第三层级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	92,082,987.08	9.82
	其中：股票	92,082,987.08	9.82
2	固定收益投资	1,910,161.60	0.20
	其中：债券	1,910,161.60	0.20
	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	791,000,000.00	84.32
	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	33,665,169.18	3.59
7	其他各项资产	19,463,759.26	2.07
8	合计	938,122,077.12	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	67,080.00	0.01
B	采矿业	3,506,760.00	0.37
C	制造业	32,154,597.80	3.44

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,892,174.00	0.42
E	建筑业	3,033,195.00	0.32
F	批发和零售业	2,234,667.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	3,182,149.00	0.34
H	住宿和餐饮业	87,904.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,863,559.00	0.52
J	金融业	29,658,953.90	3.17
K	房地产业	5,201,433.00	0.56
L	租赁和商务服务业	1,360,418.38	0.15
M	科学研究和技术服务业	96,240.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	740,191.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	146,120.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	1,502,893.00	0.16
S	综合	354,652.00	0.04
	合计	92,082,987.08	9.84

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	000651	格力电器	65,400	1,443,378.00	0.15
2	601318	中国平安	44,000	1,409,760.00	0.15
3	601601	中国太保	46,800	1,265,472.00	0.14
4	601628	中国人寿	59,100	1,230,462.00	0.13
5	601336	新华保险	30,200	1,220,080.00	0.13
6	601328	交通银行	204,000	1,148,520.00	0.12
7	601818	光大银行	304,100	1,143,416.00	0.12

8	601288	农业银行	353,700	1,131,840.00	0.12
9	002142	宁波银行	75,700	1,118,846.00	0.12
10	600016	民生银行	124,100	1,108,213.00	0.12
11	601998	中信银行	194,500	1,102,815.00	0.12
12	601939	建设银行	231,200	1,098,200.00	0.12
13	600036	招商银行	62,700	1,097,250.00	0.12
14	600015	华夏银行	110,600	1,093,834.00	0.12
15	601169	北京银行	104,900	1,087,813.00	0.12
16	601988	中国银行	335,800	1,077,918.00	0.12
17	601166	兴业银行	69,600	1,060,704.00	0.11
18	600000	浦发银行	67,870	1,056,735.90	0.11
19	000001	平安银行	106,920	930,204.00	0.10
20	601766	中国中车	93,100	853,727.00	0.09
21	000333	美的集团	29,900	709,228.00	0.08
22	600519	贵州茅台	2,400	700,608.00	0.07
23	600690	青岛海尔	69,900	620,712.00	0.07
24	601009	南京银行	63,100	592,509.00	0.06
25	000568	泸州老窖	18,500	549,450.00	0.06
26	000858	五粮液	15,100	491,203.00	0.05
27	002024	苏宁云商	45,000	488,700.00	0.05
28	002304	洋河股份	6,600	474,672.00	0.05
29	600170	上海建工	117,600	450,408.00	0.05
30	601668	中国建筑	84,000	446,880.00	0.05
31	600600	青岛啤酒	15,300	444,771.00	0.05
32	000783	长江证券	38,200	443,120.00	0.05
33	002500	山西证券	26,000	430,560.00	0.05
34	000729	燕京啤酒	56,600	429,594.00	0.05
35	002736	国信证券	24,600	424,350.00	0.05
36	002673	西部证券	16,000	413,760.00	0.04
37	000712	锦龙股份	19,900	413,124.00	0.04
38	601555	东吴证券	30,500	408,700.00	0.04
39	000686	东北证券	30,900	398,919.00	0.04
40	601901	方正证券	52,000	398,320.00	0.04
41	600109	国金证券	29,300	394,964.00	0.04
42	600376	首开股份	35,400	393,648.00	0.04
43	601688	华泰证券	20,800	393,536.00	0.04
44	600208	新潮中宝	92,500	391,275.00	0.04
45	601198	东兴证券	15,900	388,596.00	0.04
46	601788	光大证券	22,700	384,538.00	0.04
47	600999	招商证券	23,200	382,800.00	0.04
48	000166	申万宏源	45,000	378,450.00	0.04
49	600837	海通证券	24,300	374,706.00	0.04
50	601211	国泰君安	20,900	371,811.00	0.04
51	600030	中信证券	22,900	371,667.00	0.04

52	600048	保利地产	42,900	370,227.00	0.04
53	000046	泛海控股	36,400	368,004.00	0.04
54	601099	太平洋	59,900	367,187.00	0.04
55	001979	招商蛇口	25,700	366,225.00	0.04
56	600958	东方证券	21,700	364,777.00	0.04
57	600340	华夏幸福	14,800	360,824.00	0.04
58	600150	中国船舶	16,200	360,612.00	0.04
59	002146	荣盛发展	53,500	359,520.00	0.04
60	600649	城投控股	24,900	357,564.00	0.04
61	601857	中国石油	49,300	356,439.00	0.04
62	000402	金融街	36,500	354,780.00	0.04
63	000540	中天城投	56,900	354,487.00	0.04
64	002594	比亚迪	5,800	353,858.00	0.04
65	000069	华侨城A	55,100	352,640.00	0.04
66	600066	宇通客车	17,800	352,440.00	0.04
67	000415	渤海金控	51,600	351,912.00	0.04
68	600104	上汽集团	17,200	348,988.00	0.04
69	601377	兴业证券	47,100	348,069.00	0.04
70	601633	长城汽车	40,800	344,352.00	0.04
71	600369	西南证券	47,400	344,124.00	0.04
72	600383	金地集团	32,700	338,772.00	0.04
73	000625	长安汽车	24,100	329,447.00	0.04
74	600050	中国联通	86,100	328,041.00	0.04
75	000413	东旭光电	37,700	323,843.00	0.03
76	002183	怡亚通	22,400	320,768.00	0.03
77	600887	伊利股份	19,000	316,730.00	0.03
78	000503	海虹控股	7,600	305,596.00	0.03
79	002415	海康威视	14,200	304,732.00	0.03
80	300059	东方财富	13,600	301,920.00	0.03
81	002456	欧菲光	10,200	300,900.00	0.03
82	600547	山东黄金	7,700	299,607.00	0.03
83	600100	同方股份	19,800	296,208.00	0.03
84	002236	大华股份	22,600	296,060.00	0.03
85	300315	掌趣科技	28,000	293,720.00	0.03
86	600703	三安光电	14,700	293,559.00	0.03
87	600804	鹏博士	16,100	293,503.00	0.03
88	603000	人民网	17,600	292,336.00	0.03
89	000725	京东方A	125,900	290,829.00	0.03
90	000800	一汽轿车	26,300	286,144.00	0.03
91	000423	东阿阿胶	5,400	285,282.00	0.03
92	000895	双汇发展	13,600	283,968.00	0.03
93	002568	百润股份	12,900	283,800.00	0.03
94	300146	汤臣倍健	20,900	282,986.00	0.03
95	300024	机器人	11,100	281,829.00	0.03

96	000063	中兴通讯	19,400	278,196.00	0.03
97	600085	同仁堂	9,100	271,089.00	0.03
98	300104	乐视网	5,100	269,841.00	0.03
99	300017	网宿科技	4,000	268,800.00	0.03
100	603993	洛阳钼业	64,500	267,675.00	0.03
101	600485	信威集团	15,000	267,600.00	0.03
102	000999	华润三九	11,000	266,420.00	0.03
103	601006	大秦铁路	41,000	264,040.00	0.03
104	600873	梅花生物	42,500	263,925.00	0.03
105	600489	中金黄金	23,400	263,016.00	0.03
106	600688	上海石化	42,700	260,470.00	0.03
107	002424	贵州百灵	15,100	259,720.00	0.03
108	600332	白云山	10,500	258,720.00	0.03
109	000538	云南白药	4,000	257,200.00	0.03
110	600028	中国石化	54,400	256,768.00	0.03
111	601333	广深铁路	65,500	256,105.00	0.03
112	600009	上海机场	9,800	255,290.00	0.03
113	600256	广汇能源	61,700	252,970.00	0.03
114	601899	紫金矿业	74,000	249,380.00	0.03
115	600535	天士力	6,900	246,744.00	0.03
116	600252	中恒集团	56,600	245,644.00	0.03
117	600068	葛洲坝	42,200	245,604.00	0.03
118	601186	中国铁建	24,600	245,016.00	0.03
119	300124	汇川技术	12,600	244,440.00	0.03
120	601958	金钼股份	29,800	242,870.00	0.03
121	600820	隧道股份	28,800	241,632.00	0.03
122	601390	中国中铁	34,300	239,071.00	0.03
123	601800	中国交建	22,600	237,978.00	0.03
124	601669	中国电建	41,400	236,394.00	0.03
125	600666	奥瑞德	6,700	232,892.00	0.02
126	600406	国电南瑞	17,300	231,301.00	0.02
127	002241	歌尔股份	7,900	226,572.00	0.02
128	000559	万向钱潮	14,500	226,200.00	0.02
129	002252	上海莱士	6,000	226,080.00	0.02
130	002450	康得新	13,100	224,010.00	0.02
131	600196	复星医药	11,700	222,534.00	0.02
132	600111	北方稀土	16,500	219,615.00	0.02
133	000792	盐湖股份	10,300	217,330.00	0.02
134	002422	科伦药业	14,000	215,740.00	0.02
135	002294	信立泰	7,900	214,880.00	0.02
136	000338	潍柴动力	26,900	210,089.00	0.02
137	600008	首创股份	54,000	210,060.00	0.02
138	600188	兖州煤业	19,100	208,954.00	0.02
139	601225	陕西煤业	40,200	207,834.00	0.02

140	600309	万华化学	12,000	207,600.00	0.02
141	600660	福耀玻璃	14,600	204,400.00	0.02
142	300002	神州泰岳	19,200	204,288.00	0.02
143	600741	华域汽车	14,500	203,145.00	0.02
144	002470	金正大	25,100	202,055.00	0.02
145	600118	中国卫星	6,000	201,600.00	0.02
146	002202	金风科技	13,200	199,716.00	0.02
147	601992	金隅股份	25,700	199,175.00	0.02
148	000826	启迪桑德	6,500	198,575.00	0.02
149	600446	金证股份	5,500	197,725.00	0.02
150	000100	TCL 集团	59,800	196,742.00	0.02
151	002008	大族激光	8,600	196,424.00	0.02
152	600585	海螺水泥	13,500	196,290.00	0.02
153	000839	中信国安	9,200	196,052.00	0.02
154	600875	东方电气	19,800	194,436.00	0.02
155	601727	上海电气	25,500	192,780.00	0.02
156	601898	中煤能源	37,200	191,952.00	0.02
157	600900	长江电力	15,200	189,848.00	0.02
158	600352	浙江龙盛	22,000	189,640.00	0.02
159	600011	华能国际	25,200	189,504.00	0.02
160	002385	大北农	23,500	189,410.00	0.02
161	300070	碧水源	12,700	188,976.00	0.02
162	600795	国电电力	64,200	188,106.00	0.02
163	600886	国投电力	28,500	188,100.00	0.02
164	000876	新希望	22,600	188,032.00	0.02
165	600642	申能股份	32,700	187,698.00	0.02
166	600570	恒生电子	2,800	186,956.00	0.02
167	601985	中国核电	27,300	186,459.00	0.02
168	600867	通化东宝	9,000	186,210.00	0.02
169	000027	深圳能源	29,100	185,658.00	0.02
170	000883	湖北能源	40,000	185,200.00	0.02
171	600863	内蒙华电	61,300	185,126.00	0.02
172	000750	国海证券	25,000	184,750.00	0.02
173	601016	节能风电	18,600	184,698.00	0.02
174	600578	京能电力	43,100	184,468.00	0.02
175	600021	上海电力	17,900	183,833.00	0.02
176	601991	大唐发电	47,200	183,608.00	0.02
177	600674	川投能源	22,200	183,372.00	0.02
178	600098	广州发展	23,400	182,988.00	0.02
179	600276	恒瑞医药	4,560	182,901.60	0.02
180	600023	浙能电力	35,600	181,204.00	0.02
181	600839	四川长虹	40,900	180,778.00	0.02
182	601088	中国神华	12,800	180,096.00	0.02
183	600027	华电国际	35,800	177,210.00	0.02

184	601888	中国国旅	4,000	175,920.00	0.02
185	000768	中航飞机	8,900	175,241.00	0.02
186	600588	用友网络	8,900	174,262.00	0.02
187	600029	南方航空	24,600	173,676.00	0.02
188	600018	上港集团	33,800	172,380.00	0.02
189	600398	海澜之家	15,200	171,760.00	0.02
190	600317	营口港	50,900	171,024.00	0.02
191	600718	东软集团	9,300	170,376.00	0.02
192	600157	永泰能源	43,100	169,814.00	0.02
193	600089	特变电工	19,800	168,696.00	0.02
194	601718	际华集团	22,000	168,080.00	0.02
195	600221	海南航空	52,500	166,425.00	0.02
196	002153	石基信息	6,300	166,194.00	0.02
197	603885	吉祥航空	6,300	165,375.00	0.02
198	600115	东方航空	25,000	165,250.00	0.02
199	000738	中航动控	6,200	163,680.00	0.02
200	601021	春秋航空	3,400	162,996.00	0.02
201	601111	中国国航	24,100	162,916.00	0.02
202	600038	中直股份	3,900	161,772.00	0.02
203	600372	中航电子	8,300	161,601.00	0.02
204	300003	乐普医疗	8,800	160,512.00	0.02
205	601018	宁波港	32,300	159,885.00	0.02
206	002739	万达院线	2,000	159,800.00	0.02
207	600271	航天信息	6,700	159,460.00	0.02
208	600893	中航动力	4,600	159,390.00	0.02
209	601179	中国西电	31,200	158,184.00	0.02
210	601098	中南传媒	8,700	157,557.00	0.02
211	300085	银之杰	5,200	155,480.00	0.02
212	600037	歌华有线	10,200	155,142.00	0.02
213	600177	雅戈尔	11,200	154,448.00	0.02
214	300133	华策影视	9,900	154,143.00	0.02
215	600959	江苏有线	11,000	153,560.00	0.02
216	300058	蓝色光标	15,700	152,447.00	0.02
217	000060	中金岭南	14,600	152,278.00	0.02
218	000793	华闻传媒	15,400	152,152.00	0.02
219	600816	安信信托	9,000	151,830.00	0.02
220	600705	中航资本	25,800	151,704.00	0.02
221	600373	中文传媒	7,300	151,475.00	0.02
222	000825	太钢不锈	47,900	151,364.00	0.02
223	000709	河钢股份	54,600	151,242.00	0.02
224	000898	鞍钢股份	39,400	150,902.00	0.02
225	601117	中国化学	27,000	149,310.00	0.02
226	601928	凤凰传媒	14,100	148,614.00	0.02
227	000156	华数传媒	8,000	148,400.00	0.02

228	002354	天神娱乐	1,700	148,376.00	0.02
229	000963	华东医药	2,200	148,280.00	0.02
230	600637	东方明珠	6,100	148,047.00	0.02
231	002475	立讯精密	7,500	147,375.00	0.02
232	300251	光线传媒	12,700	146,812.00	0.02
233	002292	奥飞娱乐	4,900	146,755.00	0.02
234	300015	爱尔眼科	4,000	146,120.00	0.02
235	600362	江西铜业	10,800	145,584.00	0.02
236	601618	中国中冶	39,400	145,386.00	0.02
237	600998	九州通	8,300	145,333.00	0.02
238	600783	鲁信创投	6,700	144,787.00	0.02
239	300144	宋城演艺	5,800	144,478.00	0.02
240	600005	武钢股份	52,000	143,520.00	0.02
241	600010	包钢股份	50,000	143,000.00	0.02
242	601607	上海医药	7,900	142,595.00	0.02
243	000917	电广传媒	8,600	142,158.00	0.02
244	002007	华兰生物	4,500	141,300.00	0.02
245	002081	金螳螂	14,100	141,282.00	0.02
246	000630	铜陵有色	55,600	141,224.00	0.02
247	600019	宝钢股份	28,800	141,120.00	0.02
248	000778	新兴铸管	30,200	140,128.00	0.01
249	600648	外高桥	7,100	139,941.00	0.01
250	300027	华谊兄弟	10,300	139,462.00	0.01
251	000061	农产品	11,400	138,624.00	0.01
252	000157	中联重科	33,400	137,942.00	0.01
253	600415	小商品城	22,200	137,196.00	0.01
254	600031	三一重工	27,300	137,046.00	0.01
255	601608	中信重工	25,200	135,324.00	0.01
256	600827	百联股份	11,100	134,088.00	0.01
257	000425	徐工机械	43,300	132,498.00	0.01
258	600582	天地科技	29,400	132,300.00	0.01
259	601106	中国一重	25,300	131,813.00	0.01
260	601600	中国铝业	34,900	131,573.00	0.01
261	601872	招商轮船	27,900	130,572.00	0.01
262	601919	中国远洋	25,700	130,556.00	0.01
263	600895	张江高科	6,900	124,752.00	0.01
264	601866	中海集运	31,500	124,740.00	0.01
265	600871	石化油服	29,900	114,816.00	0.01
266	600583	海油工程	16,500	114,015.00	0.01
267	601313	江南嘉捷	7,800	112,944.00	0.01
268	600060	海信电器	6,300	111,384.00	0.01
269	300210	森远股份	6,200	110,856.00	0.01
270	002003	伟星股份	6,800	106,284.00	0.01
271	000039	中集集团	7,500	106,275.00	0.01

272	601968	宝钢包装	9,800	100,548.00	0.01
273	600722	金牛化工	13,500	100,305.00	0.01
274	600379	宝光股份	5,100	99,807.00	0.01
275	000791	甘肃电投	9,000	98,910.00	0.01
276	601116	三江购物	8,400	97,776.00	0.01
277	300120	经纬电材	6,500	96,395.00	0.01
278	601216	君正集团	12,900	96,363.00	0.01
279	002397	梦洁股份	11,700	96,291.00	0.01
280	002738	中矿资源	4,800	96,240.00	0.01
281	600698	湖南天雁	16,200	95,904.00	0.01
282	600243	青海华鼎	9,400	95,880.00	0.01
283	002305	南国置业	17,000	95,540.00	0.01
284	600681	百川能源	8,800	95,392.00	0.01
285	000609	绵世股份	7,400	94,942.00	0.01
286	603518	维格娜丝	3,200	94,496.00	0.01
287	002014	永新股份	5,900	94,105.00	0.01
288	002088	鲁阳节能	6,000	93,360.00	0.01
289	002578	闽发铝业	9,900	93,357.00	0.01
290	603606	东方电缆	6,700	92,795.00	0.01
291	002062	宏润建设	15,600	92,352.00	0.01
292	601518	吉林高速	23,500	92,120.00	0.01
293	600844	丹化科技	14,200	91,732.00	0.01
294	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.01
295	600052	浙江广厦	13,300	91,504.00	0.01
296	000544	中原环保	6,400	91,456.00	0.01
297	002370	亚太药业	3,100	91,450.00	0.01
298	600814	杭州解百	8,600	91,074.00	0.01
299	601258	庞大集团	32,900	90,475.00	0.01
300	600191	华资实业	6,500	90,285.00	0.01
301	000419	通程控股	12,400	90,272.00	0.01
302	002160	常铝股份	10,300	90,228.00	0.01
303	600723	首商股份	10,100	90,193.00	0.01
304	601339	百隆东方	14,200	90,170.00	0.01
305	002478	常宝股份	8,000	89,920.00	0.01
306	000951	中国重汽	9,400	89,864.00	0.01
307	600444	国机通用	4,600	89,746.00	0.01
308	300107	建新股份	13,900	89,238.00	0.01
309	002641	永高股份	10,800	88,992.00	0.01
310	600178	东安动力	10,200	88,944.00	0.01
311	600569	安阳钢铁	34,400	88,752.00	0.01
312	002420	毅昌股份	10,200	88,740.00	0.01
313	601177	杭齿前进	9,000	88,740.00	0.01
314	002300	太阳电缆	9,100	88,543.00	0.01
315	000822	山东海化	17,400	88,218.00	0.01

316	002302	西部建设	12,200	88,084.00	0.01
317	600281	太化股份	14,200	88,040.00	0.01
318	600561	江西长运	7,200	87,984.00	0.01
319	000428	华天酒店	13,400	87,904.00	0.01
320	000906	物产中拓	7,400	87,838.00	0.01
321	600658	电子城	8,500	87,805.00	0.01
322	600758	红阳能源	8,400	87,780.00	0.01
323	600356	恒丰纸业	8,200	87,740.00	0.01
324	600295	鄂尔多斯	11,100	87,579.00	0.01
325	600505	西昌电力	9,800	87,416.00	0.01
326	000708	大冶特钢	7,800	87,360.00	0.01
327	000022	深赤湾A	5,500	86,680.00	0.01
328	600810	神马股份	11,600	86,652.00	0.01
329	000715	中兴商业	6,000	86,580.00	0.01
330	601969	海南矿业	7,700	86,394.00	0.01
331	600223	鲁商置业	16,900	86,190.00	0.01
332	600724	宁波富达	16,900	86,190.00	0.01
333	600979	广安爱众	14,600	86,140.00	0.01
334	002693	双成药业	9,100	86,086.00	0.01
335	603333	明星电缆	11,600	86,072.00	0.01
336	600159	大龙地产	18,400	85,928.00	0.01
337	000756	新华制药	8,000	85,840.00	0.01
338	601188	龙江交通	21,100	85,455.00	0.01
339	600361	华联综超	13,700	85,351.00	0.01
340	000429	粤高速A	15,500	85,250.00	0.01
341	600858	银座股份	10,400	85,176.00	0.01
342	600743	华远地产	18,000	85,140.00	0.01
343	600082	海泰发展	14,700	85,113.00	0.01
344	000759	中百集团	12,300	84,993.00	0.01
345	603558	健盛集团	4,500	84,915.00	0.01
346	600246	万通地产	16,600	84,660.00	0.01
347	600126	杭钢股份	14,100	84,600.00	0.01
348	000678	襄阳轴承	10,700	84,530.00	0.01
349	600792	云煤能源	16,600	84,162.00	0.01
350	600819	耀皮玻璃	13,500	84,105.00	0.01
351	600615	丰华股份	4,700	84,083.00	0.01
352	600769	祥龙电业	9,400	83,942.00	0.01
353	002143	印纪传媒	3,566	83,551.38	0.01
354	600190	锦州港	20,600	83,430.00	0.01
355	600780	通宝能源	16,600	83,332.00	0.01
356	300268	万福生科	4,400	83,160.00	0.01
357	600507	方大特钢	17,300	83,040.00	0.01
358	600665	天地源	17,100	82,935.00	0.01
359	600860	京城股份	9,800	82,614.00	0.01

360	002096	南岭民爆	5,500	81,950.00	0.01
361	601113	华鼎股份	8,300	81,838.00	0.01
362	000912	泸天化	13,500	80,325.00	0.01
363	000560	昆百大 A	8,900	79,922.00	0.01
364	002195	二三四五	6,500	79,885.00	0.01
365	000668	荣丰控股	4,000	78,480.00	0.01
366	600421	仰帆控股	4,600	77,004.00	0.01
367	002687	乔治白	6,400	76,736.00	0.01
368	600663	陆家嘴	3,180	72,345.00	0.01
369	300261	雅本化学	5,800	70,586.00	0.01
370	601118	海南橡胶	12,000	67,080.00	0.01
371	600248	延长化建	10,900	66,490.00	0.01
372	601933	永辉超市	16,000	66,080.00	0.01
373	603889	新澳股份	3,400	49,232.00	0.01
374	000612	焦作万方	6,700	47,838.00	0.01
375	600121	郑州煤电	9,200	44,160.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601166	兴业银行	67,986,325.92	3.51
2	601988	中国银行	49,775,574.00	2.57
3	601318	中国平安	44,493,015.28	2.30
4	601601	中国太保	43,990,232.53	2.27
5	601668	中国建筑	43,132,329.28	2.23
6	601169	北京银行	40,288,583.69	2.08
7	600837	海通证券	38,829,788.09	2.01
8	600048	保利地产	38,807,886.87	2.01
9	002142	宁波银行	36,644,963.39	1.89
10	601288	农业银行	34,899,211.00	1.80
11	601818	光大银行	33,719,941.15	1.74
12	601607	上海医药	31,813,072.46	1.64
13	600196	复星医药	31,649,406.07	1.64
14	600104	上汽集团	31,123,203.03	1.61
15	600000	浦发银行	31,096,128.49	1.61
16	002415	海康威视	29,088,577.27	1.50
17	601688	华泰证券	28,353,928.04	1.47
18	600373	中文传媒	26,998,473.17	1.40

19	601788	光大证券	26,346,830.86	1.36
20	000728	国元证券	23,246,899.45	1.20

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“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。

7.4.2 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	601166	兴业银行	78,975,744.98	4.08
2	601318	中国平安	64,394,014.23	3.33
3	601668	中国建筑	53,836,611.81	2.78
4	601818	光大银行	53,721,140.33	2.78
5	601988	中国银行	50,101,366.54	2.59
6	600048	保利地产	48,667,514.80	2.52
7	601288	农业银行	43,418,120.00	2.24
8	601601	中国太保	43,379,411.09	2.24
9	601788	光大证券	42,334,159.22	2.19
10	601169	北京银行	41,932,400.04	2.17
11	601607	上海医药	39,908,367.20	2.06
12	600837	海通证券	38,987,919.48	2.02
13	600196	复星医药	38,934,487.45	2.01
14	002415	海康威视	36,001,044.76	1.86
15	600373	中文传媒	35,508,410.12	1.84
16	002142	宁波银行	34,381,168.50	1.78
17	600000	浦发银行	33,236,428.38	1.72
18	600104	上汽集团	32,828,565.33	1.70
19	601688	华泰证券	28,542,754.66	1.48
20	601766	中国中车	27,355,254.02	1.41

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,317,490,307.74
卖出股票的收入（成交）总额	2,648,447,456.50

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,910,161.60	0.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,910,161.60	0.20

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	120001	16 以岭 EB	9,240	1,024,161.60	0.11
2	127003	海印转债	8,860	886,000.00	0.09

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	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1608	IF1608	-22.00	-20,292,360.00	-455,940.00	-
IF1609	IF1609	-69.00	-63,002,520.00	-1,214,340.00	-
公允价值变动总额合计					-1,670,280.00
股指期货投资本期收益					30,849,903.21
股指期货投资本期公允价值变动					-10,668,583.21

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货以套期保值为主要目的。在构建股票投资组合的同时，通过卖出股指期货对冲市场下行风险，降低系统风险损失，提高组合收益。本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 根据公开市场信息，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，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	19,214,793.32
2	应收证券清算款	188,490.60
3	应收股利	-

4	应收利息	60,475.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,463,759.26

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	000651	格力电器	1,443,378.00	0.15	重大事项停 牌

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
7,050	116,770.93	302,845,888.49	36.79%	520,389,137.04	63.21%

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	111,086.77	0.0135%
------------------	------------	---------

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份 额比例	发起份 额总 数	发起份 额占 基金总份 额比例	发起份 额承 诺持有期 限
基金管理人固有资金	10,000,200 .02	1.21%	10,000,200 .02	1.21%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200 .02	1.21%	10,000,200 .02	1.21%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月6日）基金份额总额	1,126,397,761.48
本报告期期初基金份额总额	1,712,655,632.15
本报告期基金总申购份额	7,522,168.80
减：本报告期基金总赎回份额	896,942,775.42
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	823,235,025.53

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。 本报告期内，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，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】

34 号)。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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	
招商证券	3	3,404,384,312.21	68.57%	787,429.87	70.49%	-
银河证券	3	1,560,110,610.01	31.43%	329,655.65	29.51%	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
华泰证券	6	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	3	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
华安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	6	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	4	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	新增 1 个
东莞证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2. 交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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
招商证券	12,350,264.57	100.00%	20,024,000,000.00	100.00%	-	-

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	广发基金管理有限公司旗下基金（除 QDII 基金）资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-30
2	广发基金管理有限公司关于增加天津银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-27
3	广发基金管理有限公司关于增加苏宁基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-07
4	广发基金管理有限公司关于增加德州银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-06
5	广发基金管理有限公司关于增加华泰证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-02
6	广发基金管理有限公司关于增加富滇银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-24
7	广发基金管理有限公司关于增加大智慧财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-20
8	广发基金管理有限公司关于增加徽商银行	《中国证券报》、《证券时	2016-05-17

	旗下部分基金代销机构的公告	报》、《上海证券报》	
9	广发基金管理有限公司关于增加汇成基金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-13
10	广发基金管理有限公司关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金第五个开放期开放申购、赎回和转换的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-11
11	广发基金管理有限公司广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-10
12	广发基金管理有限公司关于增加首创证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-05-05
13	广发基金管理有限公司关于增加鼎信汇金为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-03-30
14	广发基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-18
15	广发基金管理有限公司关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金第四个开放期开放申购、赎回和转换的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-02-03
16	广发基金管理有限公司广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-29
17	广发基金管理有限公司广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金份额净值及基金资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-08

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日