

光大保德信风格轮动混合型证券投资基金
2016 年半年度报告
2016 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 2 月 4 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
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.....	12
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.....	13
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
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	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
9 开放式基金份额变动	52
10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
11 影响投资者决策的其他重要信息	57
12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信风格轮动混合
基金主代码	002305
交易代码	002305
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 4 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	73,312,481.60 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将把握不同时期风格轮动带来的投资机会，在有效控制风险前提下，力求超越业绩比较基准的投资回报，争取实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。</p> <p>（1）宏观经济运行的变化和国家的宏观调控政策将对证券市场产生深刻影响。本基金通过综合国内外宏观经济状况、国家财政政策、央行货币政策、物价水平变化趋势等因素，构建宏观经济分析平台；</p> <p>（2）运用历史数据并结合基金管理人内部的定性和定量分析模型，确定影响各类资产收益水平的先行指标，将上一步的宏观经济分析结果量化为对先行指标的影响，进而判断对各类资产收益的影响；</p> <p>（3）结合上述宏观经济对各类资产未来收益影响的分析结果和本基金投资组合的风险预算管理，确定各类资产的投资比重。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>我国 A 股市场具有独特的风格轮动特征，具体表现为强势行情在大盘、中盘、小盘板块的股票中进行切换。本基金的股票投资策略将主要采用风格轮动的投资策略，即通过量化模型的方式来跟踪、预测 A 股市场的风格轮动规律，在不同时期从大中小盘板块中选择出未来表现相对强势的，并集中投资于该板块，从而分享大中小盘轮动带来的超额收益。同时，在各板块内部，通过定量和定性相结合的方式选择优质股票来构建最终组合，从而进一步提升本基金的整体收益。</p> <p>（1）风格板块的集中投资</p> <p>本基金将采用基金管理人自主开发的风格轮动识别模型对我国 A 股市场的风格轮动进行预测。我们将 A 股市场的风格板块分为以下三种股票库：</p>

	<p>大盘风格股票库：属于沪深 300 指数成分股的全部股票。</p> <p>中盘风格股票库：除沪深 300 指数成分股及深圳证券交易所创业板上市股票之外的其余股票。</p> <p>小盘风格股票库：在深圳证券交易所创业板上市的全部股票。</p> <p>本基金应将至少 60% 的非现金资产集中投资于以上三种股票库中的一个股票库。</p> <p>(2) 个股选择</p> <p>本基金将以定性和定量相结合的方式、从价值和成长等因素对个股进行选择，综合考虑上市公司的增长潜力与市场估值水平，精选估值合理且成长性良好的上市公司进行投资。</p> <p>1) 定量分析</p> <p>本基金结合盈利增长指标、现金流量指标、负债比率指标、估值指标、盈利质量指标等与上市公司经营有关的重要定量指标，对目标上市公司的价值进行深入挖掘，并对上市公司的盈利能力、财务质量和经营效率进行评析，为个股选择提供依据。</p> <p>2) 定性分析</p> <p>A. 价值和成长性</p> <p>本基金认为股票价格的合理区间并非完全由其财务数据决定，还必须结合企业学习与创新能力、企业发展战略、技术专利优势、市场拓展能力、公司治理结构和管理水平、公司的行业地位、公司增长的可持续性 etc 定性因素，给予股票一定的折溢价水平，并最终决定股票合理的价格区间。根据上述定性定量分析的结果，本基金进一步从价值和成长两个纬度对备选股票进行评估。对于价值被低估且成长性良好的股票，本基金将重点关注；对于价值被高估但成长性良好，或价值被低估但成长性较差的股票，本基金将通过深入的调研和缜密的分析，有选择地进行投资；对于价值被高估且成长性较差的股票，本基金不予考虑投资。</p> <p>B. 事件性因素分析</p> <p>本基金所涉及的行业受政策扶持、产业升级、行业内重大事件的影响比较明显，往往会对整个行业内个股的估值水平有大范围的影响，具体包括重大行业政策变化、行业限制的放松或收紧等。</p> <p>3、固定收益类品种投资策略</p> <p>本基金投资于固定收益类品种的目的在于保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。在确定固定收益投资组合的具体品种时，本基金将根据市场对于个券的市场成交情况，对各个目标投资对象进行利差分析，包括信用利差，流动性利差，期权调整利差（OAS），并利用利率模型对利率进行模拟预测，选出定价合理或被低估，到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将在风险可控的前提下，以套期保值为目的，根据对现货和期货市场的分析，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保</p>
--	---

	<p>值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。</p> <p>5、中小企业私募债投资策略</p> <p>与传统的信用债相比，中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，整体流动性相对较差，而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。因此，对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析，并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，确定最终的投资决策。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>7、权证及其他品种投资策略</p> <p>本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价量化模型估算权证价值，主要考虑运用的策略有：价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。</p> <p>同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理工作。</p>
业绩比较基准	25%×沪深 300 指数收益率+25%×中证 500 指数收益率+25%×创业板指数收益率+25%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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		光大保德信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	田青
	联系电话	021-80262888-605	010-67595096
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008-202-888	010-67595096
传真		021-80262468	010-66275853
注册地址		上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	200002	100033
法定代表人	林昌	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金半年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国建设银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,353,459.23
本期利润	4,375,390.80
加权平均基金份额本期利润	0.0545
本期加权平均净值利润率	5.42%
本期基金份额净值增长率	3.70%
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	1,695,002.47
期末可供分配基金份额利润	0.02
期末基金资产净值	75,995,918.39
期末基金份额净值	1.037
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	3.70%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

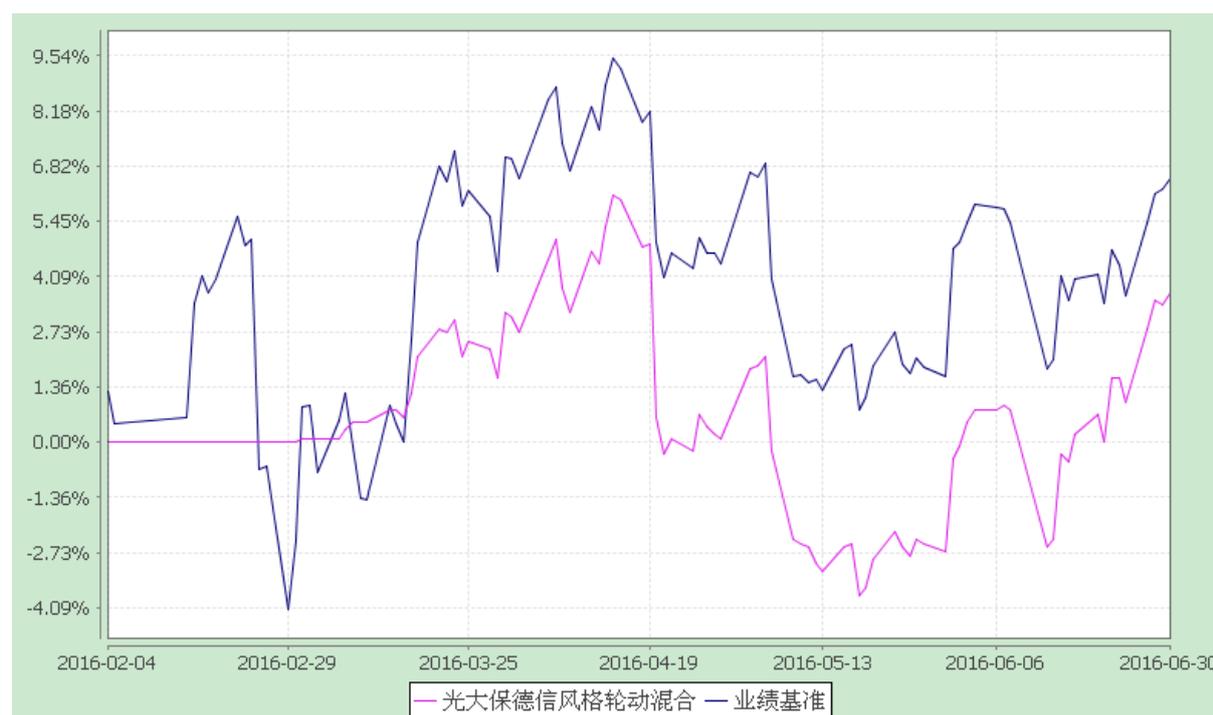
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.12%	1.12%	1.63%	1.10%	2.49%	0.02%
过去三个月	0.58%	1.12%	-0.47%	1.14%	1.05%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.70%	0.92%	6.49%	1.40%	-2.79%	-0.48%

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

光大保德信风格轮动混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2016 年 2 月 4 日至 2016 年 6 月 30 日)



注：本基金合同未满一年，尚处于建仓期。根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2016 年 2 月 4 日至 2016 年 8 月 3 日。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翟云飞	基金经理	2016-02-04	-	6 年	翟云飞先生，博士，2010 年 6 月至 2014 年 3 月在大成基金任职，其中 2010 年 6 月至 2011 年 5 月任职金融工程师、2011 年 5 月至 2012 年 7 月任职产品设计师、2012 年 7 月至 2014 年 3 月任职量化投资研究员、行业投资研究员；2014 年 4 月加入光大保德信基金，担任金

					融工程师（负责量化投资研究）、高级量化研究员。现任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金经理。
赵大年	基金经理	2016-02-04	-	9 年	赵大年先生，硕士，2007 年 6 月至 2007 年 10 月在申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理；2007 年 10 月至 2009 年 4 月在钧锋投资咨询有限公司任职投资经理；2009 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监（负责量化投资研究等），2014 年 8 月至今担任量化投资部总监。现任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金经理、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年年初市场经历一波剧烈下跌调整，从交易量上看，截至 3 月底仍未恢复元气。二季度以来，市场步入震荡调整阶段，期间中证全指指数上涨 0.00%，细分指数表现：沪深 300 下跌 1.99%，中证 500 指数下跌 0.53%，创业板指下跌 0.47%。虽然市场整体震荡，但大中小盘风格切换明显，且强势风格持续时间较短，主题热点频发。

自本基金募集成立以来，整个上半年仍处于建仓期，本着勤勉谨慎原则，我们保持中性仓位，紧密跟随市场大中小风格轮动，紧贴业绩比较基准，取得较好效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 3.70%，业绩比较基准收益率为 6.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着 6 月份英国脱欧公投结果公布，全球市场避险情绪进一步抬升，主要股票指数震荡剧烈。公投对全球经济影响较大，各国货币政策或因此而出现变化。超预期的政治事件也给全球的经济复苏带来深远的负面影响，叠加美国二季度经济数据不及预期，我们认为美国加息计划搁浅。

目前，我国经济增速放缓，长期“L”型走势被市场充分认知，已不是最主要的风险点。当前我国经济数据较疲弱，存贷差继续上涨，实业投资动力不足，产业分化较大；“存量经济”难有亮点，但第三产业和房地产表现较好。

资本市场方面，基于经济基本面难有持续“亮点”出现，我们判断市场整体下半年不会存在趋势性的机会，震荡行情将继续演绎；但这并不妨碍市场出现局部性的、结构性的风格轮动带来的投资机会。我们将精心布局结构，跟随市场风格轮动，力求继续获得超越市场的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程

程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

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

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内出现了连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，该情况自 2016 年 4 月 22 日起出现，于 2016 年 6 月 15 日终止。本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信风格轮动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
资 产：		-
银行存款	6.4.7.1	19,154,281.27
结算备付金		155,012.35
存出保证金		13,775.01
交易性金融资产	6.4.7.2	58,831,503.47
其中：股票投资		58,831,503.47
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	3,883.17
应收股利		-
应收申购款		6,308,676.00

递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		84,467,131.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 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		5,156,622.02
应付赎回款		2,961,782.13
应付管理人报酬	6.4.10.2	67,476.49
应付托管费	6.4.10.2	11,246.07
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	97,198.22
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	176,887.95
负债合计		8,471,212.88
所有者权益:		-
实收基金	6.4.7.9	73,312,481.60
未分配利润	6.4.7.10	2,683,436.79
所有者权益合计		75,995,918.39
负债和所有者权益总计		84,467,131.27

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.037 元，基金份额总额 73,312,481.60 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信风格轮动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		5,284,843.35
1.利息收入		585,448.21
其中：存款利息收入	6.4.7.11	583,399.60
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,048.61

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		858,938.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	666,888.97
基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-
股利收益	6.4.7.18	192,049.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,021,931.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	818,525.01
减：二、费用		909,452.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2	511,809.71
2. 托管费	6.4.10.2	85,301.58
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.21	136,324.63
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.22	176,016.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,375,390.80
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,375,390.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信风格轮动混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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）	216,682,586.41	-	216,682,586.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,375,390.80	4,375,390.80
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）	-143,370,104.81	-1,691,954.01	-145,062,058.82
其中：1.基金申购款	59,689,061.46	-73,952.31	59,615,109.15

2.基金赎回款	-203,059,166.27	-1,618,001.70	-204,677,167.97
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）	73,312,481.60	2,683,436.79	75,995,918.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：林昌，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信风格轮动混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]3004 号《关于准予光大保德信风格轮动混合型证券投资基金注册的批复》核准，由光大保德信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 216,657,891.82 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 174 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 2 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 216,682,586.41 份，其中认购资金利息折合 24,694.59 份基金份额。本基金的基金管理人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、固定收益类金融工具(包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券、货币市场工具、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款等)、权证、股指期货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。本基金股票资产占基金资产的比例为 60%—95%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。每个交易日日终在扣除股指期货保证金以后，基金保留的现金或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%。本基金的业绩比较基

准为：25%×沪深 300 指数收益率+25%×中证 500 指数收益率+25%×创业板指数收益率+25%×中证全债指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 2 月 4 日至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用

入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交

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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对最近市场交易价格进行调整，确定公允价值。

(2)不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，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公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(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或赎回基金份额时，申购或赎回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确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“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。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(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票面利率计算的金额，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摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(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，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)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；

(8)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；

(9)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、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)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)基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2)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)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)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。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 10 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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为两种：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

利按除权日除权后的基金份额净值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收益分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的

通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	19,154,281.27
定期存款	-
其他存款	-
合计	19,154,281.27

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	55,809,571.90	58,831,503.47	3,021,931.57
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	55,809,571.90	58,831,503.47	3,021,931.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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	3,770.60
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	75.90
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	36.67
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	3,883.17

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	97,198.22
银行间市场应付交易费用	-
合计	97,198.22

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	3,030.87
其他	-
应付银行划款手续费	-
应付转出费	-
预提审计费	26,746.56
预提信息披露费	147,110.52
合计	176,887.95

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	216,682,586.41	216,682,586.41
本期申购	59,689,061.46	59,689,061.46
本期赎回（以“-”号填列）	-203,059,166.27	-203,059,166.27
本期末	73,312,481.60	73,312,481.60

注：截止 2016 年 2 月 4 日止，本基金已收到首次募集扣除认购费用后的有效认购金额为人民币 216,657,891.82 元，折合 216,657,891.82 份基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 24,694.59 元，折合 24,694.59 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 216,682,586.41 元，折合 216,682,586.41 份基金份额。申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	1,353,459.23	3,021,931.57	4,375,390.80
本期基金份额交易产生的	341,543.24	-2,033,497.25	-1,691,954.01

变动数			
其中：基金申购款	1,377,390.82	-1,451,343.13	-73,952.31
基金赎回款	-1,035,847.58	-582,154.12	-1,618,001.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,695,002.47	988,434.32	2,683,436.79

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	66,712.74
定期存款利息收入	515,666.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	942.12
其他	78.07
合计	583,399.60

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	29,075,535.95
减：卖出股票成本总额	28,408,646.98
买卖股票差价收入	666,888.97

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未进行资产支持证券投资。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期末进行衍生工具投资。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	192,049.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	192,049.59

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
1.交易性金融资产	3,021,931.57
——股票投资	3,021,931.57
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	3,021,931.57

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
基金赎回费收入	810,542.92
转换费收入	7,982.09
合计	818,525.01

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
交易所市场交易费用	136,324.63
银行间市场交易费用	-
合计	136,324.63

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
审计费用	26,746.56
信息披露费	147,110.52
银行汇划费用	2,159.55
合计	176,016.63

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大影响关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司（简称“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期间无应支付关联方的佣金。

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2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	511,809.71
其中：支付销售机构的客户维护费	275,403.10

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,301.58

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期间未做银行间市场债券（含回购）的关联交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

光大证券股份有限公司本报告期申购 1,727,979.45 份，申购费 13,492.06 元；赎回 1,727,979.45 份，赎回费 13,167.20 元。上述费用均按照本基金招募说明书公示费率收取。

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2月4日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	19,154,281.27	66,712.74

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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 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
000524	岭南控股	2016-04-05	重大事项	13.08	-	-	900.00	10,795.91	11,772.00	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	40,200.00	678,449.12	672,144.00	-
000916	华北高速	2016-06-24	重大事项	5.01	-	-	15,500.00	71,671.29	77,655.00	-

002567	唐人神	2016-05-16	重大事项	13.98	2016-07-29	13.23	2,200.00	21,337.50	30,756.00	-
002574	明牌珠宝	2016-06-27	重大事项	13.04	-	-	9,300.00	105,230.82	121,272.00	-
002611	东方精工	2016-03-29	重大事项	10.84	2016-08-18	11.92	1,400.00	13,210.00	15,176.00	-
002630	华西能源	2016-04-25	重大事项	11.06	-	-	4,200.00	45,654.00	46,452.00	-
002632	道明光学	2016-06-22	重大事项	11.98	-	-	600.00	7,050.00	7,188.00	-
300032	金龙机电	2016-06-28	重大事项	20.10	2016-07-07	19.80	1,900.00	33,191.00	38,190.00	-
300052	中青宝	2016-06-08	重大事项	22.03	-	-	2,900.00	59,934.00	63,887.00	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大事项	27.47	-	-	1,400.00	35,347.86	38,458.00	-
300176	鸿特精密	2016-04-27	重大事项	30.20	-	-	300.00	7,567.86	9,060.00	-
300225	金力泰	2016-03-22	重大事项	7.12	2016-07-08	7.58	5,700.00	38,251.00	40,584.00	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事项	34.99	2016-08-12	36.69	300.00	9,053.64	10,497.00	-
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项	8.99	-	-	11,400.00	75,218.72	102,486.00	-
300334	津膜科技	2016-05-20	重大事项	18.05	-	-	2,700.00	44,414.41	48,735.00	-
300345	红宇新材	2016-06-21	重大事项	10.46	2016-07-19	11.46	5,700.00	59,113.80	59,622.00	-
300385	雪浪环境	2016-06-21	重大事项	35.67	2016-07-05	37.38	1,700.00	53,924.00	60,639.00	-
300413	快乐购	2016-06-20	重大事项	24.35	-	-	1,000.00	26,602.36	24,350.00	-
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90	-	-	8,300.00	46,104.11	40,670.00	-
600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项	5.52	2016-07-01	5.62	117,900.00	621,186.81	650,808.00	-
600237	铜峰电子	2016-06-30	重大事项	7.61	2016-07-07	7.42	2,000.00	14,220.00	15,220.00	-
600475	华光股份	2016-05-18	重大事项	14.85	-	-	1,400.00	20,538.00	20,790.00	-
600614	鼎立股份	2016-04-26	重大事项	8.14	-	-	8,400.00	66,402.00	68,376.00	-
300284	苏交科	2016-05-20	重大事项	23.61	2016-08-10	21.44	2,600.00	48,451.75	61,386.00	-

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险及其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证保证金及债券投资等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,154,281.27	-	-	-	-	-	19,154,281.27
结算备付金	155,012.35	-	-	-	-	-	155,012.35
存出保证金	13,775.01	-	-	-	-	-	13,775.01
交易性金融资产	-	-	-	-	-	58,831,503.47	58,831,503.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	3,883.17	3,883.17
应收申购款	-	-	-	-	-	6,308,676.00	6,308,676.00
资产总计	19,323,068.63	-	-	-	-	65,144,062.64	84,467,131.27

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,156,622.02	5,156,622.02
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,961,782.13	2,961,782.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,476.49	67,476.49
应付托管费	-	-	-	-	-	11,246.07	11,246.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	97,198.22	97,198.22
其他负债	-	-	-	-	-	176,887.95	176,887.95
负债总计	-	-	-	-	-	8,471,212.88	8,471,212.88
利率敏感度缺口	19,323,068.63	-	-	-	-	56,672,849.76	75,995,918.39

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券，因此无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	58,831,503.47	77.41

交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	58,831,503.47	77.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）
		本期末 2016年6月30日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 35
	业绩比较基准下降 1%	减少约 35

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

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	58,831,503.47	69.65
	其中：股票	58,831,503.47	69.65
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	19,309,293.62	22.86
7	其他各项资产	6,326,334.18	7.49
8	合计	84,467,131.27	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	700,119.00	0.92
B	采矿业	844,491.00	1.11
C	制造业	32,452,517.41	42.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,792,226.00	2.36
E	建筑业	1,141,725.40	1.50
F	批发和零售业	1,835,226.60	2.41
G	交通运输、仓储和邮政业	1,234,021.00	1.62
H	住宿和餐饮业	66,876.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,003,272.10	9.22
J	金融业	5,266,508.96	6.93
K	房地产业	3,395,354.00	4.47
L	租赁和商务服务业	322,109.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	361,120.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	362,129.00	0.48
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	1,952,654.00	2.57
S	综合	101,154.00	0.13
	合计	58,831,503.47	77.41

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港股通股票。

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	002566	益盛药业	79,124.00	1,030,985.72	1.36
2	600657	信达地产	185,600.00	924,288.00	1.22
3	601398	工商银行	187,000.00	830,280.00	1.09
4	002315	焦点科技	12,300.00	829,758.00	1.09
5	600642	申能股份	143,400.00	823,116.00	1.08
6	601288	农业银行	255,100.00	816,320.00	1.07
7	600238	海南椰岛	67,200.00	803,040.00	1.06
8	601628	中国人寿	37,828.00	787,578.96	1.04
9	601988	中国银行	239,300.00	768,153.00	1.01
10	601328	交通银行	120,300.00	677,289.00	0.89
11	000728	国元证券	40,200.00	672,144.00	0.88
12	601318	中国平安	20,800.00	666,432.00	0.88
13	600166	福田汽车	117,900.00	650,808.00	0.86
14	600017	日照港	156,500.00	633,825.00	0.83
15	300336	新文化	22,500.00	562,050.00	0.74
16	601668	中国建筑	103,400.00	550,088.00	0.72
17	300082	奥克股份	69,300.00	539,847.00	0.71
18	603366	日出东方	63,900.00	536,760.00	0.71
19	600765	中航重机	34,700.00	505,926.00	0.67
20	300310	宜通世纪	13,220.00	504,871.80	0.66
21	600582	天地科技	104,700.00	471,150.00	0.62
22	000725	京东方 A	200,000.00	462,000.00	0.61
23	000666	经纬纺机	23,500.00	458,250.00	0.60
24	600410	华胜天成	40,580.00	455,307.60	0.60
25	300059	东方财富	18,800.00	417,360.00	0.55
26	600648	外高桥	19,200.00	378,432.00	0.50
27	300194	福安药业	17,200.00	372,380.00	0.49
28	300139	晓程科技	24,800.00	364,808.00	0.48
29	600256	广汇能源	88,300.00	362,030.00	0.48
30	300007	汉威电子	12,500.00	349,000.00	0.46
31	601179	中国西电	66,200.00	335,634.00	0.44
32	300202	聚龙股份	13,800.00	334,098.00	0.44
33	300255	常山药业	40,180.00	333,494.00	0.44
34	300114	中航电测	10,677.00	318,174.60	0.42
35	300287	飞利信	23,600.00	316,240.00	0.42
36	300050	世纪鼎利	21,810.00	313,845.90	0.41
37	300364	中文在线	5,978.00	310,856.00	0.41
38	300275	梅安森	13,600.00	308,584.00	0.41

39	300096	易联众	16,800.00	308,112.00	0.41
40	300291	华录百纳	12,800.00	301,184.00	0.40
41	300270	中威电子	17,000.00	289,510.00	0.38
42	300295	三六五网	8,800.00	286,000.00	0.38
43	002203	海亮股份	36,500.00	283,605.00	0.37
44	300099	尤洛卡	30,610.00	269,368.00	0.35
45	300148	天舟文化	17,700.00	269,217.00	0.35
46	300154	瑞凌股份	24,900.00	257,217.00	0.34
47	300395	菲利华	9,350.00	250,393.00	0.33
48	300233	金城医药	9,400.00	243,366.00	0.32
49	300213	佳讯飞鸿	8,600.00	242,864.00	0.32
50	300039	上海凯宝	22,900.00	232,893.00	0.31
51	300178	腾邦国际	12,000.00	230,400.00	0.30
52	300316	晶盛机电	17,500.00	229,250.00	0.30
53	300214	日科化学	29,600.00	227,920.00	0.30
54	300020	银江股份	12,000.00	223,200.00	0.29
55	300392	腾信股份	8,100.00	219,348.00	0.29
56	601388	怡球资源	10,200.00	218,994.00	0.29
57	002578	闽发铝业	23,100.00	217,833.00	0.29
58	600108	亚盛集团	42,000.00	212,100.00	0.28
59	300183	东软载波	7,800.00	206,700.00	0.27
60	600888	新疆众和	29,000.00	206,480.00	0.27
61	601137	博威合金	15,200.00	203,832.00	0.27
62	300153	科泰电源	7,300.00	197,027.00	0.26
63	601898	中煤能源	37,700.00	194,532.00	0.26
64	300103	达刚路机	10,400.00	194,480.00	0.26
65	300207	欣旺达	7,500.00	192,525.00	0.25
66	300026	红日药业	11,000.00	191,290.00	0.25
67	300066	三川智慧	19,500.00	190,905.00	0.25
68	300271	华宇软件	9,800.00	185,416.00	0.24
69	601677	明泰铝业	13,800.00	184,092.00	0.24
70	002365	永安药业	9,900.00	180,279.00	0.24
71	300062	中能电气	7,200.00	174,456.00	0.23
72	600050	中国联通	45,200.00	172,212.00	0.23
73	300161	华中数控	5,600.00	171,640.00	0.23
74	600557	康缘药业	10,460.00	170,811.80	0.22
75	600267	海正药业	13,800.00	167,670.00	0.22
76	600501	航天晨光	9,100.00	167,440.00	0.22
77	002433	太安堂	16,700.00	167,334.00	0.22
78	300205	天喻信息	11,300.00	167,127.00	0.22
79	300132	青松股份	20,700.00	166,428.00	0.22
80	300049	福瑞股份	7,000.00	166,390.00	0.22
81	002474	榕基软件	8,800.00	166,320.00	0.22
82	000566	海南海药	15,200.00	165,832.00	0.22

83	600062	华润双鹤	9,100.00	165,802.00	0.22
84	600529	山东药玻	9,300.00	163,773.00	0.22
85	600382	广东明珠	10,100.00	161,600.00	0.21
86	300203	聚光科技	6,100.00	161,040.00	0.21
87	000756	新华制药	15,000.00	160,950.00	0.21
88	000597	东北制药	18,100.00	160,728.00	0.21
89	600771	广誉远	5,500.00	160,270.00	0.21
90	300354	东华测试	5,900.00	158,415.00	0.21
91	300408	三环集团	8,700.00	156,252.00	0.21
92	000043	中航地产	18,900.00	155,925.00	0.21
93	300326	凯利泰	6,200.00	154,938.00	0.20
94	300122	智飞生物	10,000.00	154,700.00	0.20
95	002540	亚太科技	17,700.00	154,344.00	0.20
96	002338	奥普光电	2,500.00	153,625.00	0.20
97	300012	华测检测	12,400.00	153,512.00	0.20
98	300211	亿通科技	11,170.00	153,364.10	0.20
99	300253	卫宁健康	6,200.00	153,140.00	0.20
100	000411	英特集团	8,200.00	151,618.00	0.20
101	600791	京能置业	21,800.00	151,510.00	0.20
102	002083	孚日股份	24,000.00	151,200.00	0.20
103	002133	广宇集团	23,400.00	150,696.00	0.20
104	600498	烽火通信	6,200.00	150,536.00	0.20
105	300090	盛运环保	18,500.00	149,665.00	0.20
106	002551	尚荣医疗	6,400.00	149,632.00	0.20
107	600064	南京高科	10,000.00	149,500.00	0.20
108	600510	黑牡丹	17,000.00	148,240.00	0.20
109	600479	千金药业	8,700.00	146,943.00	0.19
110	000709	河钢股份	52,900.00	146,533.00	0.19
111	600223	鲁商置业	28,600.00	145,860.00	0.19
112	600239	云南城投	31,400.00	145,696.00	0.19
113	000153	丰原药业	14,100.00	145,371.00	0.19
114	600246	万通地产	28,500.00	145,350.00	0.19
115	300155	安居宝	9,900.00	145,332.00	0.19
116	300237	美晨科技	15,300.00	144,126.00	0.19
117	300078	思创医惠	4,300.00	143,792.00	0.19
118	300357	我武生物	3,800.00	143,108.00	0.19
119	300333	兆日科技	6,000.00	142,800.00	0.19
120	300018	中元股份	11,200.00	142,352.00	0.19
121	300349	金卡股份	3,300.00	141,900.00	0.19
122	600222	太龙药业	17,700.00	141,069.00	0.19
123	300001	特锐德	6,400.00	138,816.00	0.18
124	002185	华天科技	10,780.00	137,229.40	0.18
125	000877	天山股份	22,200.00	137,196.00	0.18
126	000910	大亚科技	8,700.00	134,415.00	0.18

127	000701	厦门信达	7,600.00	133,988.00	0.18
128	300218	安利股份	8,700.00	133,893.00	0.18
129	002156	通富微电	9,430.00	132,963.00	0.17
130	002045	国光电器	9,300.00	132,804.00	0.17
131	002449	国星光电	10,000.00	132,700.00	0.17
132	600467	好当家	34,100.00	132,649.00	0.17
133	000748	长城信息	6,700.00	131,454.00	0.17
134	002376	新北洋	9,800.00	130,928.00	0.17
135	000965	天保基建	21,900.00	129,648.00	0.17
136	002321	华英农业	13,700.00	129,054.00	0.17
137	601588	北辰实业	29,800.00	127,246.00	0.17
138	300109	新开源	2,000.00	127,000.00	0.17
139	600460	士兰微	16,000.00	126,880.00	0.17
140	300055	万邦达	6,900.00	125,649.00	0.17
141	300401	花园生物	4,600.00	125,120.00	0.16
142	600845	宝信软件	5,600.00	124,936.00	0.16
143	600602	仪电电子	11,800.00	124,608.00	0.16
144	000809	铁岭新城	28,500.00	124,545.00	0.16
145	600858	银座股份	15,200.00	124,488.00	0.16
146	002187	广百股份	10,000.00	123,200.00	0.16
147	002351	漫步者	9,500.00	123,120.00	0.16
148	300232	洲明科技	7,700.00	122,045.00	0.16
149	600859	王府井	7,990.00	121,767.60	0.16
150	300182	捷成股份	7,100.00	121,481.00	0.16
151	002574	明牌珠宝	9,300.00	121,272.00	0.16
152	000402	金融街	12,400.00	120,528.00	0.16
153	300146	汤臣倍健	8,800.00	119,152.00	0.16
154	000601	韶能股份	11,400.00	119,130.00	0.16
155	600824	益民集团	19,900.00	118,803.00	0.16
156	300124	汇川技术	6,100.00	118,340.00	0.16
157	300272	开能环保	7,600.00	117,268.00	0.15
158	600195	中牧股份	6,400.00	117,120.00	0.15
159	603003	龙宇燃油	6,100.00	116,876.00	0.15
160	300003	乐普医疗	6,400.00	116,736.00	0.15
161	300064	豫金刚石	11,400.00	116,052.00	0.15
162	000823	超声电子	11,500.00	115,000.00	0.15
163	000543	皖能电力	16,100.00	114,954.00	0.15
164	000733	振华科技	5,100.00	114,750.00	0.15
165	000759	中百集团	16,600.00	114,706.00	0.15
166	300293	蓝英装备	6,400.00	114,560.00	0.15
167	300238	冠昊生物	2,600.00	114,088.00	0.15
168	002368	太极股份	3,200.00	113,696.00	0.15
169	000698	沈阳化工	17,300.00	113,142.00	0.15
170	300075	数字政通	4,400.00	112,860.00	0.15

171	600292	远达环保	8,800.00	111,496.00	0.15
172	002339	积成电子	6,100.00	111,264.00	0.15
173	002309	中利科技	6,200.00	111,042.00	0.15
174	600997	开滦股份	21,300.00	110,760.00	0.15
175	300337	银邦股份	14,000.00	110,180.00	0.14
176	300120	经纬电材	7,400.00	109,742.00	0.14
177	300098	高新兴	6,900.00	109,572.00	0.14
178	000685	中山公用	10,500.00	108,990.00	0.14
179	600127	金健米业	17,500.00	108,675.00	0.14
180	300378	鼎捷软件	3,740.00	107,412.80	0.14
181	300224	正海磁材	4,729.00	107,206.43	0.14
182	000027	深圳能源	16,700.00	106,546.00	0.14
183	300269	联建光电	4,100.00	106,518.00	0.14
184	000780	平庄能源	19,600.00	106,232.00	0.14
185	600780	通宝能源	21,100.00	105,922.00	0.14
186	002350	北京科锐	5,200.00	105,040.00	0.14
187	600720	祁连山	15,600.00	104,676.00	0.14
188	300185	通裕重工	11,700.00	104,364.00	0.14
189	601126	四方股份	9,900.00	104,247.00	0.14
190	600290	华仪电气	10,600.00	103,562.00	0.14
191	000789	万年青	16,700.00	103,206.00	0.14
192	600811	东方集团	15,400.00	102,564.00	0.13
193	300323	华灿光电	11,400.00	102,486.00	0.13
194	002648	卫星石化	11,300.00	102,152.00	0.13
195	600449	宁夏建材	11,300.00	101,926.00	0.13
196	601579	会稽山	7,200.00	101,808.00	0.13
197	300289	利德曼	6,800.00	101,728.00	0.13
198	601636	旗滨集团	31,700.00	100,806.00	0.13
199	300439	美康生物	2,800.00	100,744.00	0.13
200	300262	巴安水务	6,500.00	99,580.00	0.13
201	300257	开山股份	6,000.00	99,120.00	0.13
202	600801	华新水泥	15,700.00	99,067.00	0.13
203	300156	神雾环保	4,800.00	98,784.00	0.13
204	000903	云内动力	12,300.00	98,769.00	0.13
205	300177	中海达	6,500.00	98,540.00	0.13
206	600880	博瑞传播	11,500.00	97,865.00	0.13
207	000665	湖北广电	6,600.00	97,812.00	0.13
208	002374	丽鹏股份	14,200.00	97,270.00	0.13
209	002463	沪电股份	18,400.00	97,152.00	0.13
210	601666	平煤股份	23,700.00	96,933.00	0.13
211	000722	湖南发展	7,000.00	96,810.00	0.13
212	601616	广电电气	17,100.00	96,786.00	0.13
213	600059	古越龙山	9,400.00	96,726.00	0.13
214	002479	富春环保	8,600.00	96,578.00	0.13

215	600308	华泰股份	19,700.00	96,136.00	0.13
216	002398	建研集团	7,300.00	95,922.00	0.13
217	600006	东风汽车	10,800.00	95,796.00	0.13
218	600561	江西长运	7,800.00	95,316.00	0.13
219	300054	鼎龙股份	3,800.00	95,076.00	0.13
220	300101	振芯科技	3,400.00	94,962.00	0.12
221	300320	海达股份	7,200.00	94,824.00	0.12
222	603167	渤海轮渡	9,500.00	94,525.00	0.12
223	002062	宏润建设	15,720.00	93,062.40	0.12
224	600021	上海电力	9,000.00	92,430.00	0.12
225	002330	得利斯	8,600.00	92,364.00	0.12
226	000900	现代投资	13,700.00	92,338.00	0.12
227	002541	鸿路钢构	5,300.00	91,319.00	0.12
228	601117	中国化学	16,500.00	91,245.00	0.12
229	300383	光环新网	2,400.00	90,960.00	0.12
230	002565	上海绿新	12,200.00	90,402.00	0.12
231	600098	广州发展	11,500.00	89,930.00	0.12
232	600805	悦达投资	10,300.00	89,404.00	0.12
233	600963	岳阳林纸	14,500.00	88,740.00	0.12
234	300076	GQY 视讯	7,600.00	88,692.00	0.12
235	600496	精工钢构	20,800.00	88,608.00	0.12
236	300342	天银机电	2,900.00	88,334.00	0.12
237	600327	大东方	9,800.00	87,416.00	0.12
238	300309	吉艾科技	6,500.00	86,320.00	0.11
239	600425	青松建化	20,300.00	86,275.00	0.11
240	600026	中海发展	14,600.00	86,140.00	0.11
241	000951	中国重汽	8,920.00	85,275.20	0.11
242	600580	卧龙电气	7,600.00	85,196.00	0.11
243	300065	海兰信	2,200.00	85,096.00	0.11
244	600831	广电网络	6,500.00	84,240.00	0.11
245	000589	黔轮胎 A	16,000.00	84,000.00	0.11
246	300198	纳川股份	5,200.00	83,668.00	0.11
247	300209	天泽信息	3,300.00	83,325.00	0.11
248	300286	安科瑞	2,800.00	83,132.00	0.11
249	002014	永新股份	5,200.00	82,940.00	0.11
250	300370	安控科技	7,300.00	82,928.00	0.11
251	300004	南风股份	4,200.00	82,320.00	0.11
252	300426	唐德影视	1,200.00	81,840.00	0.11
253	600089	特变电工	9,600.00	81,792.00	0.11
254	600057	象屿股份	7,900.00	81,212.00	0.11
255	300121	阳谷华泰	5,900.00	80,771.00	0.11
256	600105	永鼎股份	8,600.00	80,582.00	0.11
257	300168	万达信息	3,100.00	80,569.00	0.11
258	600757	长江传媒	9,500.00	79,705.00	0.10

259	601801	皖新传媒	6,800.00	79,356.00	0.10
260	002216	三全食品	9,200.00	79,120.00	0.10
261	300229	拓尔思	3,700.00	79,106.00	0.10
262	002662	京威股份	5,200.00	78,572.00	0.10
263	002510	天汽模	9,400.00	78,208.00	0.10
264	600033	福建高速	24,600.00	77,982.00	0.10
265	300129	泰胜风能	11,100.00	77,700.00	0.10
266	300245	天玑科技	3,500.00	77,700.00	0.10
267	000916	华北高速	15,500.00	77,655.00	0.10
268	300236	上海新阳	1,500.00	75,885.00	0.10
269	300172	中电环保	8,200.00	75,522.00	0.10
270	300339	润和软件	2,100.00	75,264.00	0.10
271	600268	国电南自	9,900.00	75,042.00	0.10
272	000488	晨鸣纸业	9,400.00	74,636.00	0.10
273	300212	易华录	2,500.00	74,425.00	0.10
274	300095	华伍股份	5,600.00	73,976.00	0.10
275	600068	葛洲坝	12,600.00	73,332.00	0.10
276	600073	上海梅林	6,400.00	73,280.00	0.10
277	300077	国民技术	3,700.00	73,260.00	0.10
278	300152	科融环境	9,700.00	73,138.00	0.10
279	000825	太钢不锈	23,000.00	72,680.00	0.10
280	600090	啤酒花	5,800.00	72,268.00	0.10
281	000933	*ST 神火	15,700.00	72,220.00	0.10
282	002614	蒙发利	6,000.00	72,060.00	0.09
283	300016	北陆药业	3,100.00	70,835.00	0.09
284	300348	长亮科技	1,900.00	70,224.00	0.09
285	600458	时代新材	4,500.00	70,110.00	0.09
286	300034	钢研高纳	3,168.00	70,012.80	0.09
287	002420	毅昌股份	8,000.00	69,600.00	0.09
288	600614	鼎立股份	8,400.00	68,376.00	0.09
289	000521	美菱电器	11,300.00	68,139.00	0.09
290	000063	中兴通讯	4,600.00	65,964.00	0.09
291	002585	双星新材	6,200.00	65,844.00	0.09
292	300100	双林股份	1,500.00	65,715.00	0.09
293	300431	暴风集团	900.00	65,250.00	0.09
294	300415	伊之密	3,800.00	65,208.00	0.09
295	300234	开尔新材	3,000.00	64,800.00	0.09
296	002534	杭锅股份	6,000.00	63,900.00	0.08
297	300052	中青宝	2,900.00	63,887.00	0.08
298	300189	神农基因	11,400.00	63,840.00	0.08
299	600129	太极集团	3,600.00	63,756.00	0.08
300	300303	聚飞光电	6,700.00	63,717.00	0.08
301	002026	山东威达	5,000.00	62,850.00	0.08
302	300455	康拓红外	2,800.00	62,832.00	0.08

303	600761	安徽合力	6,200.00	62,558.00	0.08
304	002170	芭田股份	7,400.00	62,456.00	0.08
305	002406	远东传动	7,200.00	61,704.00	0.08
306	002683	宏大爆破	7,500.00	61,500.00	0.08
307	300284	苏交科	2,600.00	61,386.00	0.08
308	300385	雪浪环境	1,700.00	60,639.00	0.08
309	002258	利尔化学	6,400.00	60,096.00	0.08
310	300256	星星科技	3,300.00	59,796.00	0.08
311	300144	宋城演艺	2,400.00	59,784.00	0.08
312	300158	振东制药	3,700.00	59,755.00	0.08
313	300345	红宇新材	5,700.00	59,622.00	0.08
314	000528	柳工	9,100.00	58,968.00	0.08
315	601717	郑煤机	10,300.00	58,710.00	0.08
316	300136	信维通信	2,800.00	58,688.00	0.08
317	002255	海陆重工	6,800.00	58,548.00	0.08
318	300201	海伦哲	3,100.00	58,435.00	0.08
319	000422	湖北宜化	9,500.00	58,045.00	0.08
320	000816	智慧农业	9,800.00	57,918.00	0.08
321	002318	久立特材	5,000.00	57,850.00	0.08
322	000157	中联重科	13,900.00	57,407.00	0.08
323	002204	大连重工	14,200.00	57,368.00	0.08
324	600249	两面针	8,200.00	57,236.00	0.08
325	000708	大冶特钢	5,100.00	57,120.00	0.08
326	600277	亿利洁能	9,600.00	57,120.00	0.08
327	002037	久联发展	3,500.00	56,630.00	0.07
328	600141	兴发集团	4,900.00	56,448.00	0.07
329	300382	斯莱克	1,500.00	56,370.00	0.07
330	300119	瑞普生物	3,500.00	56,175.00	0.07
331	300013	新宁物流	3,100.00	55,645.00	0.07
332	000425	徐工机械	18,100.00	55,386.00	0.07
333	000428	华天酒店	8,400.00	55,104.00	0.07
334	300281	金明精机	3,700.00	54,908.00	0.07
335	300024	机器人	2,160.00	54,842.40	0.07
336	300261	雅本化学	4,500.00	54,765.00	0.07
337	002454	松芝股份	3,000.00	54,540.00	0.07
338	002092	中泰化学	6,400.00	54,144.00	0.07
339	300094	国联水产	3,700.00	54,094.00	0.07
340	603699	纽威股份	3,000.00	53,220.00	0.07
341	603001	奥康国际	2,500.00	53,150.00	0.07
342	300104	乐视网	1,000.00	52,910.00	0.07
343	300053	欧比特	2,900.00	52,635.00	0.07
344	300471	厚普股份	1,100.00	52,624.00	0.07
345	001696	宗申动力	4,800.00	52,416.00	0.07
346	300011	鼎汉技术	2,200.00	51,634.00	0.07

347	000850	华茂股份	8,700.00	50,895.00	0.07
348	600596	新安股份	6,900.00	50,301.00	0.07
349	300384	三联虹普	1,000.00	50,300.00	0.07
350	300087	荃银高科	4,400.00	50,160.00	0.07
351	000731	四川美丰	6,900.00	49,887.00	0.07
352	600481	双良节能	8,700.00	49,851.00	0.07
353	002394	联发股份	3,300.00	49,830.00	0.07
354	600810	神马股份	6,600.00	49,302.00	0.06
355	601339	百隆东方	7,700.00	48,895.00	0.06
356	300334	津膜科技	2,700.00	48,735.00	0.06
357	000563	陕国投 A	8,800.00	48,312.00	0.06
358	600117	西宁特钢	9,600.00	48,288.00	0.06
359	300089	文化长城	3,900.00	48,048.00	0.06
360	000830	鲁西化工	10,600.00	47,912.00	0.06
361	002630	华西能源	4,200.00	46,452.00	0.06
362	000978	桂林旅游	4,300.00	45,193.00	0.06
363	300359	全通教育	1,500.00	44,490.00	0.06
364	300115	长盈精密	2,140.00	44,084.00	0.06
365	300067	安诺其	5,200.00	43,628.00	0.06
366	300313	天山生物	2,600.00	42,640.00	0.06
367	002029	七匹狼	4,200.00	42,630.00	0.06
368	600019	宝钢股份	8,300.00	40,670.00	0.05
369	300225	金力泰	5,700.00	40,584.00	0.05
370	600196	复星医药	2,100.00	39,942.00	0.05
371	300204	舒泰神	2,159.00	39,811.96	0.05
372	300166	东方国信	1,400.00	38,458.00	0.05
373	300297	蓝盾股份	2,400.00	38,232.00	0.05
374	300032	金龙机电	1,900.00	38,190.00	0.05
375	601607	上海医药	2,100.00	37,905.00	0.05
376	300005	探路者	2,200.00	37,510.00	0.05
377	300017	网宿科技	515.00	34,608.00	0.05
378	600048	保利地产	3,700.00	31,931.00	0.04
379	002567	唐人神	2,200.00	30,756.00	0.04
380	300437	清水源	1,100.00	30,041.00	0.04
381	600595	中孚实业	4,600.00	25,944.00	0.03
382	300019	硅宝科技	1,400.00	25,186.00	0.03
383	600485	信威集团	1,400.00	24,976.00	0.03
384	300413	快乐购	1,000.00	24,350.00	0.03
385	000766	通化金马	1,200.00	24,048.00	0.03
386	300285	国瓷材料	600.00	23,934.00	0.03
387	300465	高伟达	300.00	22,542.00	0.03
388	600219	南山铝业	3,000.00	22,200.00	0.03
389	600475	华光股份	1,400.00	20,790.00	0.03
390	000778	新兴铸管	4,400.00	20,416.00	0.03

391	000952	广济药业	1,200.00	20,232.00	0.03
392	002675	东诚药业	400.00	18,612.00	0.02
393	300043	互动娱乐	1,300.00	18,421.00	0.02
394	300102	乾照光电	2,000.00	18,160.00	0.02
395	600399	抚顺特钢	2,800.00	18,116.00	0.02
396	600375	*ST 星马	3,100.00	17,856.00	0.02
397	600685	中船防务	700.00	17,752.00	0.02
398	002550	千红制药	2,100.00	17,514.00	0.02
399	300449	汉邦高科	300.00	17,142.00	0.02
400	002124	天邦股份	1,600.00	17,040.00	0.02
401	600533	栖霞建设	3,300.00	16,632.00	0.02
402	600325	华发股份	1,500.00	16,605.00	0.02
403	000926	福星股份	1,400.00	16,422.00	0.02
404	600266	北京城建	1,300.00	16,237.00	0.02
405	300360	炬华科技	700.00	15,841.00	0.02
406	000070	特发信息	600.00	15,732.00	0.02
407	002386	天原集团	2,200.00	15,708.00	0.02
408	600257	大湖股份	1,400.00	15,582.00	0.02
409	600237	铜峰电子	2,000.00	15,220.00	0.02
410	002611	东方精工	1,400.00	15,176.00	0.02
411	002604	龙力生物	1,400.00	15,106.00	0.02
412	002005	德豪润达	2,500.00	14,775.00	0.02
413	002655	共达电声	900.00	14,535.00	0.02
414	002599	盛通股份	400.00	14,328.00	0.02
415	300150	世纪瑞尔	1,300.00	14,079.00	0.02
416	002564	天沃科技	1,800.00	13,860.00	0.02
417	002261	拓维信息	1,000.00	13,830.00	0.02
418	002144	宏达高科	700.00	13,762.00	0.02
419	600361	华联综超	2,200.00	13,706.00	0.02
420	600499	科达洁能	800.00	13,528.00	0.02
421	600280	中央商场	2,000.00	13,520.00	0.02
422	600775	南京熊猫	900.00	13,455.00	0.02
423	000939	凯迪生态	1,500.00	13,425.00	0.02
424	000156	华数传媒	700.00	12,985.00	0.02
425	600168	武汉控股	1,300.00	12,688.00	0.02
426	002218	拓日新能	1,200.00	12,240.00	0.02
427	000524	岭南控股	900.00	11,772.00	0.02
428	601699	潞安环能	1,800.00	11,772.00	0.02
429	600175	美都能源	2,500.00	11,750.00	0.02
430	600023	浙能电力	2,300.00	11,707.00	0.02
431	600881	亚泰集团	2,400.00	11,568.00	0.02
432	600397	安源煤业	2,600.00	11,492.00	0.02
433	600616	金枫酒业	1,100.00	11,242.00	0.01
434	600416	湘电股份	900.00	11,223.00	0.01

435	600161	天坛生物	400.00	11,116.00	0.01
436	002622	永大集团	900.00	11,070.00	0.01
437	601700	风范股份	1,500.00	10,935.00	0.01
438	000716	黑芝麻	1,600.00	10,816.00	0.01
439	600875	东方电气	1,100.00	10,802.00	0.01
440	600279	重庆港九	1,500.00	10,695.00	0.01
441	300242	明家联合	300.00	10,497.00	0.01
442	002461	珠江啤酒	900.00	10,458.00	0.01
443	000599	青岛双星	1,500.00	10,320.00	0.01
444	002060	粤水电	1,500.00	10,305.00	0.01
445	000026	飞亚达 A	900.00	10,287.00	0.01
446	002665	首航节能	1,300.00	10,257.00	0.01
447	002228	合兴包装	1,800.00	10,008.00	0.01
448	002328	新朋股份	1,000.00	9,980.00	0.01
449	000429	粤高速 A	1,800.00	9,900.00	0.01
450	000090	天健集团	1,120.00	9,856.00	0.01
451	000635	英力特	800.00	9,632.00	0.01
452	300176	鸿特精密	300.00	9,060.00	0.01
453	000572	海马汽车	1,700.00	8,823.00	0.01
454	002260	德奥通航	300.00	7,785.00	0.01
455	000530	大冷股份	700.00	7,462.00	0.01
456	600967	北方创业	700.00	7,441.00	0.01
457	002743	富煌钢构	500.00	7,210.00	0.01
458	002632	道明光学	600.00	7,188.00	0.01
459	600470	六国化工	900.00	6,759.00	0.01
460	000811	烟台冰轮	600.00	6,732.00	0.01
461	002538	司尔特	700.00	6,545.00	0.01
462	300165	天瑞仪器	600.00	6,498.00	0.01
463	002004	华邦健康	700.00	6,391.00	0.01
464	002211	宏达新材	500.00	5,930.00	0.01
465	002087	新野纺织	700.00	5,523.00	0.01
466	603099	长白山	300.00	5,373.00	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600642	申能股份	1,028,783.00	1.35
2	601988	中国银行	997,086.00	1.31
3	600657	信达地产	981,055.00	1.29

4	002566	益盛药业	965,396.87	1.27
5	600238	海南椰岛	841,205.00	1.11
6	601328	交通银行	831,015.00	1.09
7	601398	工商银行	803,756.00	1.06
8	601288	农业银行	800,305.00	1.05
9	601628	中国人寿	795,037.20	1.05
10	002315	焦点科技	773,483.00	1.02
11	600017	日照港	696,479.00	0.92
12	000728	国元证券	683,545.00	0.90
13	601318	中国平安	665,329.00	0.88
14	600239	云南城投	665,174.00	0.88
15	603366	日出东方	659,295.05	0.87
16	600166	福田汽车	627,073.00	0.83
17	300336	新文化	609,973.00	0.80
18	300082	奥克股份	607,525.00	0.80
19	000725	京东方 A	599,383.00	0.79
20	601668	中国建筑	564,804.00	0.74

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600056	中国医药	589,946.00	0.78
2	600239	云南城投	546,247.28	0.72
3	000001	平安银行	517,325.00	0.68
4	601998	中信银行	505,358.00	0.66
5	600199	金种子酒	503,942.00	0.66
6	000793	华闻传媒	488,011.00	0.64
7	601107	四川成渝	438,653.00	0.58
8	601555	东吴证券	414,018.00	0.54
9	600068	葛洲坝	404,837.00	0.53
10	600999	招商证券	384,295.00	0.51
11	600805	悦达投资	380,392.00	0.50
12	000166	申万宏源	375,782.00	0.49
13	300058	蓝色光标	361,305.00	0.48
14	600815	厦工股份	359,862.00	0.47
15	002038	双鹭药业	323,190.00	0.43
16	300275	梅安森	303,289.00	0.40
17	600037	歌华有线	303,267.00	0.40
18	601601	中国太保	300,618.00	0.40
19	601989	中国重工	291,058.00	0.38
20	002540	亚太科技	264,707.31	0.35

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	84,218,218.88
卖出股票的收入（成交）总额	29,075,535.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

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

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，

谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,775.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,883.17
5	应收申购款	6,308,676.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,326,334.18

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内本基金没有其他需要说明的重要事项。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
572	128,168.67	0.00	0.00%	73,312,481.60	100.00%

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	219,844.25	0.30%

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	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年2月4日）基金份额总额	216,682,586.41
--------------------------	----------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	59,689,061.46
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	203,059,166.27
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	73,312,481.60

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华鑫证券	1	4,725,351.01	4.17%	4,306.34	4.43%	-
西南证券	1	7,186,174.41	6.34%	6,548.94	6.74%	-
海通证券	1	13,397,385.93	11.83%	12,209.15	12.56%	-

中金公司	1	17,606,392.80	15.54%	16,044.75	16.51%	-
上海证券	1	19,644,483.16	17.34%	17,902.39	18.42%	-
长江证券	1	20,495,891.23	18.09%	18,678.30	19.22%	-
东兴证券	1	30,238,076.29	26.69%	21,508.35	22.13%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

报告期内无新增和停止租用交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服

务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

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

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期权 证成交总 额的比例
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	50,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金份额发售公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
2	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金招募说明书	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
3	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金合同	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
4	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金托管协议	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
5	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金合同内容摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
6	关于光大保德信风格轮动混合型证券投资基金招募说明书及份额发售公告的更正公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-07
7	关于旗下部分基金新增联讯证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-08
8	关于旗下光大保德信风格轮动混合型证券投资基金新增招商银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-08
9	关于旗下光大保德信风格轮动混合型证券投资基金新增上海陆金所资产管理有限公司为	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-16

	代销机构的公告		
10	关于旗下光大保德信风格轮动混合型证券投资基金新增交通银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-25
11	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-02-03
12	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-02-05
13	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-05
14	光大保德信基金管理有限公司关于对通过网上直销平台（包括移动终端平台）进行光大保德信风格轮动混合型证券投资基金的申购、定期定额投资和基金转换实行费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-05
15	光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信风格轮动混合型证券投资基金开通部分代销机构定期定额投资及转换业务并参加其交易费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-05
16	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国建设银行开通定期定额投资及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-23
17	光大保德信基金管理有限公司关于部分基金在中国光大银行股份有限公司开通定期定额投资及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-23
18	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金产品新增上海利得基金销售有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-06
19	光大保德信基金管理有限公司关于调整招商银行“一卡通”借记卡网上直销平台（含移动终端）交易费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-07
20	光大保德信基金管理有限公司关于旗下光大保德信风格轮动混合型证券投资基金新增深圳新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-07
21	光大保德信风格轮动混合型证券投资基金在招商银行开通定期定额投资及转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-12
22	关于光大保德信风格轮动混合型证券投资基金在平安银行开通定期定额投资及转换业务并参与其费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-25
23	关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-27

24	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分产品新增光大证券股份有限公司为代销机构并参与费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-01
25	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在平安证券开通定期定额投资及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-14
26	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-24
27	光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日