

泓德优选成长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：泓德基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2016年8月27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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月25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.....	6
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.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	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.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51

10.1	基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	52
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8	其他重大事件	54
§11	备查文件目录	56
11.1	备查文件目录	56
11.2	存放地点	57
11.3	查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德优选成长混合型证券投资基金
基金简称	泓德优选成长混合
基金主代码	001256
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月21日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,792,154,017.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,通过优选具有良好成长性的上市公司的股票,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过深入分析宏观经济指标、微观经济指标、市场指标及政策变化,动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例,提高配置效率。本基金对股票的投资中,主要采用自下而上为主的个股优选策略,结合行业发展前景、企业盈利、经营管理能力等因素构建投资组合,并根据流动性和估值水平进行动态调整。同时,本基金将本着谨慎原则,从风险管理角度出发,适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高收益的品种,其长期风险与收益特征低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	张建春
	联系电话	010-59850177	010-63639180
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4009-100-888	95595
传真		010-59322130	010-63639132
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100088	100033
法定代表人		王德晓	唐双宁

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hongdefund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§ 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	121,783,044.93
本期利润	20,549,172.12
加权平均基金份额本期利润	0.0059
本期加权平均净值利润率	0.60%
本期基金份额净值增长率	-2.30%
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	220,293,525.34
期末可供分配基金份额利润	0.0581
期末基金资产净值	4,026,568,095.07
期末基金份额净值	1.062
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	6.20%

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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	3.61%	0.91%	-0.25%	0.78%	3.86%	0.13%
过去三个月	4.84%	0.97%	-1.47%	0.81%	6.31%	0.16%
过去六个月	-2.30%	1.68%	-12.01%	1.47%	9.71%	0.21%
过去一年	15.94%	1.92%	-22.62%	1.84%	38.56%	0.08%
自基金合同生效日起 至今（2015年05月21 日-2016年06月30日）	6.20%	1.92%	-26.09%	1.94%	32.29%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数*20%

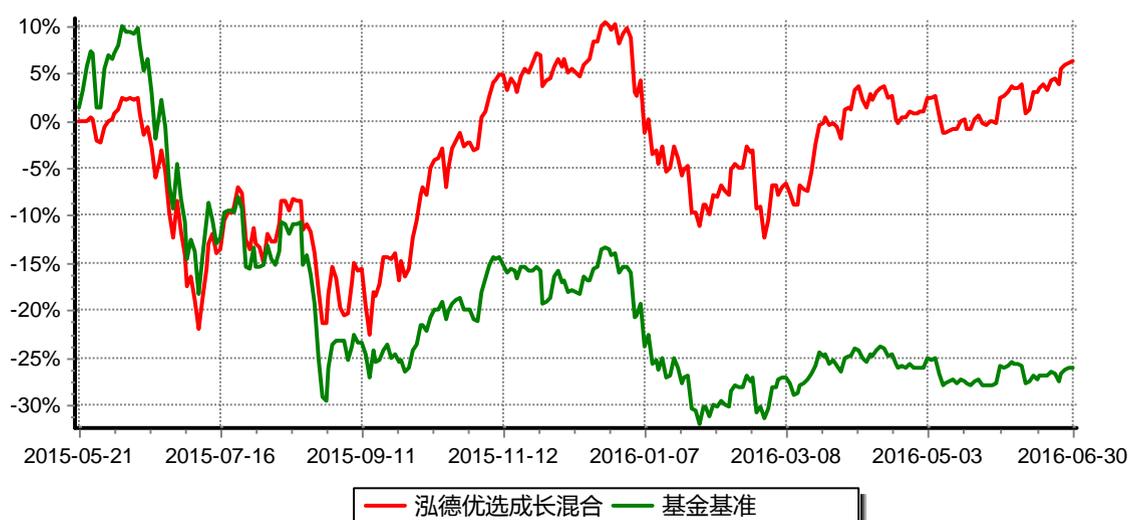
基准指数的构建原则如下：

(1) 沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

(2) 中证综合债券指数是中国全市场债券指数，以2001年12月31日为基期，基点为100点，并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

(3) 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告日，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§ 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

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币12,000万元，公司注册地在拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓26%，阳光保险集团股份有限公司25%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）16.667%，南京民生租赁股份有限公司13.875%，江苏岛村实业发展有限公司13.875%，上海捷朔信息技术有限公司4.583%。截至2016年6月30日，总资产管理规模为231.27亿元，其中：公募基金管理规模129.63亿元，专户产品管理规模101.64亿元。公司发行九只公募基金产品以及多只专户产品，包括：偏股型基金七只、债券型基金、货币基金各一只，完成了从权益类产品到固定收益类产品、从公募基金到专户的全方位产品布局。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王克玉	本基金基金经理	2015年10月9日	—	13年	硕士研究生，具有基金从业资格，历任元大京华证券上海代表处研究员、天相投资顾问有限公司分析师、国都证券有限公司分析师、长盛基金管理有限公司基金经理及权益投资部副总监。现任泓德优选成长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据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遵规守信情况的说明

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》及其各项实施细则、《泓德优选成长混合型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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与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的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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

2016年上半年面对的投资环境仍然比较困难。元旦过后的第一周市场跌幅就达到12.75%，前两周累计跌幅超过20%，一月份市场跌幅达到25.67%，是历史上跌幅最大的月份之一；在经过二月份的震荡整理后，市场在三月份出现大幅度的反弹，使得一季度

的跌幅缩小到16.8%。市场在二季度重新进入平静期，整个季度的各分类指数表现差异较小，中证流通、中小板和创业板指数的波动幅度没有超过0.5%，表现最差的上证指数的跌幅也只有2.47%，市场通过缩量震荡的形式来消化各方面的信息；然而在稳定的市场环境里，估值较低、业绩稳健增长、分红率高的公司获得非常明显的超额收益。

在2015年底泓德优选成长基金调整为相对较低的权益资产仓位和中大盘偏低估值的组合风格，从一月下旬开始组合开始快速提高权益仓位，买入的主要是长期看好的医疗服务、智能驾驶、出口导向型公司，期间较高的仓位也导致组合在二月份市场的波动中跌幅较大，组合净值创出2016年以来的新低。幸运的是在三月份市场的反弹中前期布局的品种得以较好的表现，到一季度末净值跌幅收敛到-6.8%。从四月份开始将组合逐渐调整为中性的权益资产仓位，主要是自下而上聚焦于业绩改善型的公司，在二季度勉强跟住市场的波动。组合中表现较好的仍然是前期布局的新能源汽车+智能汽车产业链中的公司；投资过程中较早对家电、汽车等低估值个股进行跟踪和投资，但是在市场演进过程中没有及时的增加持仓，导致组合表现在5月份后低于预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为1.062元，本报告期份额净值增长率为-2.30%，同期业绩比较基准增长率为-12.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1 对宏观经济和证券市场展望

在上半年全国一线和二线城市的房地产价格出现明显上涨，带动了土地市场成交的活跃，房地产投资有机会进入短期的反弹阶段；但这也将对社会运行成本造成很大的压力，并进一步压缩企业的投资动力。从长期看，进取型企业在整合全球资源、业务转型升级上的不懈努力将为经济的健康发展注入动力。

二季度以来证券市场的基础制度在不断完善之中，发行制度、交易停牌制度等方面的完善将有利于市场的长期健康发展，更及时的信息披露提高了市场的透明度，这将有利于形成稳定的市场预期。从上市公司层面看，消费和部分中游行业实现了较快的盈利增长，但整体盈利仍然面临很大的压力。市场中不同行业、风格的分类指数之间的估值

水平分化明显，高估和低估并存，市场更可能通过持续的震荡来消化估值压力；不确定性因素在于市场的流动性变化趋势。

4.5.2 本基金下阶段投资策略

基于当前市场的估值水平、企业盈利预期和市场运行状态，下一阶段我们会用偏中性的权益资产仓位来应对市场的波动，结构上除了保持目前组合中低估值、高分红率的公司外，将继续增加对医疗、消费品中的中小市值的稳健成长性公司的投资。另外也会加强对短期估值水平较高，但长期市场空间较大的产业的研究，寻找合适的布局机会。

泓德优选成长基金是公司成立以来发行的第一支产品，在本报告期运行已满一年，期末组合净值维持在一元面值以上，通过辛勤的努力让大多数持有人在经过一年的市场动荡后没有亏损，这让我们倍感欣慰。后期我们将力争通过勤勉、审慎的投资运作，努力为长期持有人奉献更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关

估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2016年6月30日，期末可供分配利润为220,293,525.34元，其中：未分配利润已实现部分为220,293,525.34元，未分配利润未实现部分14,120,551.94元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行在泓德优选成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对泓德优选成长混合型证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督和提示，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、

托管协议等的规定，对基金管理人泓德基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由基金管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行依法对基金管理人泓德基金管理有限公司编制的《泓德优选成长混合型证券投资基金2016年半年度报告》进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§ 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：泓德优选成长混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	564,455,156.08	643,253,218.48
结算备付金		62,626,065.96	2,555,902.90
存出保证金		10,027,126.09	1,372,651.62
交易性金融资产	6.4.7.2	3,000,686,861.83	2,286,844,069.66
其中：股票投资		2,775,964,861.83	2,045,354,835.06
基金投资		—	—
债券投资		224,722,000.00	241,489,234.60
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—

买入返售金融资产	6.4.7.4	100,000,000.00	200,000,000.00
应收证券清算款		296,977,743.23	—
应收利息	6.4.7.5	1,902,523.52	5,924,412.66
应收股利		—	—
应收申购款		3,211,004.85	31,381,183.02
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		4,039,886,481.56	3,171,331,438.34
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		—	246,953,110.77
应付赎回款		6,441,260.29	1,936,026.14
应付管理人报酬		4,848,820.87	3,421,494.85
应付托管费		808,136.82	570,249.14
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	1,106,285.02	2,821,126.48
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	113,883.49	146,612.89
负债合计		13,318,386.49	255,848,620.27
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,792,154,017.79	2,683,287,471.21
未分配利润	6.4.7.10	234,414,077.28	232,195,346.86
所有者权益合计		4,026,568,095.07	2,915,482,818.07

负债和所有者权益总计		4,039,886,481.56	3,171,331,438.34
------------	--	------------------	------------------

注：1、报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.062元，基金份额总额3,792,154,017.79份。

2、本基金合同于2015年5月21日生效，上年度财务报表实际编制期间为2015年5月21日至2015年12月31日止期间。

6.2 利润表

会计主体：泓德优选成长混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年5月21日至2015年6月30日
一、收入		55,327,092.73	-184,669,117.29
1.利息收入		9,724,360.28	2,511,003.68
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,873,982.42	1,788,729.58
债券利息收入		4,414,811.72	2,650.92
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		435,566.14	719,623.18
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		144,977,943.62	12,833,996.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	107,049,666.64	10,450,522.80
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	695,267.46	-15,784.10
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	4,171,136.00	—
股利收益	6.4.7.15	33,061,873.52	2,399,257.62
3.公允价值变动收益（损失以	6.4.7.16	-101,233,872.81	-200,014,117.29

“-”号填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,858,661.64	—
减: 二、费用		34,777,920.61	6,382,127.01
1. 管理人报酬		25,670,683.46	3,683,156.04
2. 托管费		4,278,447.24	613,859.37
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	4,688,488.04	2,059,200.58
5. 利息支出		22,249.79	—
其中: 卖出回购金融资产支出		22,249.79	—
6. 其他费用	6.4.7.19	118,052.08	25,911.02
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		20,549,172.12	-191,051,244.30
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		20,549,172.12	-191,051,244.30

注: 本基金合同生效日为2015年5月21日, 上年度可比区间是指2015年5月21日至2015年6月30日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 泓德优选成长混合型证券投资基金

本报告期: 2016年1月1日至2016年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,683,287,471.21	232,195,346.86	2,915,482,818.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	20,549,172.12	20,549,172.12
三、本期基金份额交易产生的	1,108,866,546.5	-18,330,441.70	1,090,536,104.88

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	8		
其中：1.基金申购款	1,818,259,218.30	-20,988,177.64	1,797,271,040.66
2.基金赎回款	-709,392,671.72	2,657,735.94	-706,734,935.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	3,792,154,017.79	234,414,077.28	4,026,568,095.07
项 目	上年度可比期间 2015年5月21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)	2,281,152,885.80	—	2,281,152,885.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-191,051,244.30	-191,051,244.30
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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
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)	2,281,152,885.80	-191,051,244.30	2,090,101,641.50

注：本基金合同生效日为2015年5月21日，上年度可比区间是指2015年5月21日至2015年6月30日。

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：

王德晓

王德晓

李娇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德优选成长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]649号《关于准予泓德优选成长混合型证券投资基金注册的批复》核准，由泓德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《泓德优选成长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2,280,985,104.16元，且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(2015)第547号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德优选成长混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,281,152,885.80份，其中认购资金利息折合167,781.64份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德优选成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标为在有效控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，通过优选具有良好成长性的上市公司的股票，追求基金资产的长期稳定增值。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准予上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券等）、资产支持证券、权证、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的60%-95%；现金、债券及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-40%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证综合债券指数×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德优选成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月1日至2016年6月30日止期间的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1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,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,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起,对基金从上市公司取得的股息红利所得,

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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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	564,455,156.08
定期存款	—
其中:存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	564,455,156.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,762,719,632.44	2,775,964,861.83	13,245,229.39
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	223,165,730.00	224,722,000.00

	合计	223,165,730.00	224,722,000.00	1,556,270.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
	合计	2,985,885,362.44	3,000,686,861.83	14,801,499.39

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			
	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	36,888,096.00	—	—	
其中：股指期货投资	36,888,096.00	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	36,888,096.00	—	—	

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(元)	公允价值变动(元)
IC1609	中证500股指期货1609合约	17	19,958,680.00	2,623,984.00
IC1612	中证500股指期货1612合约	15	16,968,600.00	1,749,960.00
IF1609	沪深300股指期货1609合约	5	4,565,400.00	230,640.00
总额合计				4,604,584.00
减：可抵消期货暂收款				4,604,584.00
股指期货投资净额				0

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	100,000,000.00	—
合计	100,000,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	37,011.74
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	374,556.12
应收债券利息	1,465,101.37
应收买入返售证券利息	25,262.51
应收申购款利息	0.68
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	591.10
合计	1,902,523.52

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	1,106,285.02
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,106,285.02

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	14,431.41
预提费用	99,452.08
合计	113,883.49

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	2,683,287,471.21	2,683,287,471.21
本期申购	1,818,259,218.30	1,818,259,218.30
本期赎回（以“-”号填列）	-709,392,671.72	-709,392,671.72
本期末	3,792,154,017.79	3,792,154,017.79

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	63,562,511.16	168,632,835.70	232,195,346.86
本期利润	121,783,044.93	-101,233,872.81	20,549,172.12
本期基金份额交易产生的变动数	34,947,969.25	-53,278,410.95	-18,330,441.70

其中：基金申购款	61,034,193.18	-82,022,370.82	-20,988,177.64
基金赎回款	-26,086,223.93	28,743,959.87	2,657,735.94
本期已分配利润	—	—	—
本期末	220,293,525.34	14,120,551.94	234,414,077.28

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	511,826.74
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	4,304,782.75
其他	57,372.93
合计	4,873,982.42

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	1,536,928,703.52
减：卖出股票成本总额	1,429,879,036.88
买卖股票差价收入	107,049,666.64

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	133,200,192.72

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	129,681,136.41
减：应收利息总额	2,823,788.85
买卖债券差价收入	695,267.46

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年1月1日至2016年6月30日
股指期货投资收益	4,171,136.00

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	33,061,873.52
基金投资产生的股利收益	—
合计	33,061,873.52

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-105,838,456.81
——股票投资	-102,005,495.60
——债券投资	-3,832,961.21
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0

——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	4,604,584.00
——权证投资	—
期货投资	4,604,584.00
3.其他	—
合计	-101,233,872.81

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	1,853,154.28
转换费收入	5,507.36
合计	1,858,661.64

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。
2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的25%归入转出基金的基金资产。

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	4,687,063.04
银行间市场交易费用	1,425.00
合计	4,688,488.04

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	49,726.04
信息披露费	49,726.04
其他	600.00
账户维护费	18,000.00
合计	118,052.08

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，本基金无须做披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无须做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

本报告期不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。

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
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（以下简称“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东

注：下述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

本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6 月30日	上年度可比期间 2015年5月21日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,670,683.46	3,683,156.04
其中：支付销售机构的客户维护费	360,351.00	114,463.20

注：1、本基金合同生效日为2015年5月21日，上年度可比区间是指2015年5月21日至2015年6月30日。

2、支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率每日计提，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

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5月21日至2015年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,278,447.24	613,859.37

注：1、本基金合同生效日为2015年5月21日，上年度可比区间是指2015年5月21日至2015年6月30日。

2、支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人本期末未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
南京民生租赁 股份有限公司	495,049.50	0.01%	495,049.50	0.02%
王德晓	987,355.99	0.03%	987,355.99	0.04%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年5月21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
中国光大银行	564,455,156.08	511,826.74	353,314,463.41	545,438.23

注：1、本基金合同生效日为2015年5月21日，上年度可比区间是指2015年5月21日至2015年6月30日。

2、本基金的活期存款由基金托管人中国光大银行保管，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

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期未发生其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额	说明
002709	天赐材料	2015-11-10	2016-11-14	非公开发行	35	49.76	1,864,285	26,099,990	92,766,821.6	该股票于2016年5月13日实施权益分派方案：每10股派1.80元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增15股。
300303	聚飞光电	2015-12-02	2016-12-14	非公开发行	9.13	9.32	1,095,290	9,999,997.7	10,208,102.8	该股票于2016年6月24日实施权益分派方案：每10股派0.50元人民币现金（含税）。
300334	津膜科技	2015-12-23	2016-12-26	非公开发行	26.52	18.05	1,131,222	30,000,007.44	20,418,557.1	
300508	维宏股份	2016-04-12	2017-04-19	新股锁定	20.08	254.5	10,383	208,490.64	2,642,473.5	
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股未上市	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	
00280	丰元	2016-06-29	2016-	新股	5.8	5.8	971	5,631.	5,631.8	

5	股份		07-07	未上市				8		
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股未上市	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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	期末成本总额	期末估值总额	说明
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项停牌	14.12		—	50,000	700,913.00	706,000.00	
002712	思美传媒	2016-04-11	重大事项停牌	38.02	2016-08-17	41.82	2,001	32,843.92	76,078.02	
300227	光韵达	2016-06-20	重大事项停牌	23.79		—	186,667	4,719,149.66	4,440,807.93	
300332	天壕环境	2016-04-11	重大事项停牌	9.37	2016-07-29	9.91	20,000	220,012.00	187,400.00	

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

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

6.4.13.2信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的账户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于2016年6月30日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除6.4.13.4.1.1中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	564,455,156.08	—	—	—	564,455,156.08
结算备付金	62,626,065.96	—	—	—	62,626,065.96
存出保证金	10,027,126.09	—	—	—	10,027,126.09
交易性金融资产	—	224,722,000.00	—	2,775,964,861.83	3,000,686,861.83
买入返售金融资产	100,000,000.00	—	—	—	100,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	296,977,743.23	296,977,743.23
应收利息	—	—	—	1,902,523.52	1,902,523.52
应收申购款	1,997.00	—	—	3,209,007.85	3,211,004.85

资产总计	737,110,345 .13	224,722,000 .00	—	3,078,054,1 36.43	4,039,886,4 81.56
负债					
应付证券清算款	—	—	—		
应付赎回款	—	—	—	6,441,260.2 9	6,441,260.2 9
应付管理人报酬	—	—	—	4,848,820.8 7	4,848,820.8 7
应付托管费	—	—	—	808,136.82	808,136.82
应付交易费用	—	—	—	1,106,285.0 2	1,106,285.0 2
其他负债	—	—	—	113,883.49	113,883.49
负债总计	—	—	—	13,318,386. 49	13,318,386. 49
利率敏感度缺口	737,110,345 .13	224,722,000 .00	—	3,064,735,7 49.94	4,026,568,0 95.07
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	643,253,218 .48	—	—	—	643,253,218 .48
结算备付金	2,555,902.9 0	—	—	—	2,555,902.9 0
存出保证金	1,372,651.6 2	—	—	—	1,372,651.6 2
交易性金融资产	—	240,052,880 .60	1,436,354.0 0	2,045,354,8 35.06	2,286,844,0 69.66
买入返售金融资产	200,000,000 .00	—	—	—	200,000,000 .00
应收利息	—	—	—	5,924,412.6 6	5,924,412.6 6
应收申购款	30,004,198.	—	—	1,376,984.1	31,381,183.

	87			5	02
资产总计	877,185,971.87	240,052,880.60	1,436,354.00	2,052,656,231.87	3,171,331,438.34
负债					
应付证券清算款	—	—	—	246,953,110.77	246,953,110.77
应付赎回款	—	—	—	1,936,026.14	1,936,026.14
应付管理人报酬	—	—	—	3,421,494.85	3,421,494.85
应付托管费	—	—	—	570,249.14	570,249.14
应付交易费用	—	—	—	2,821,126.48	2,821,126.48
其他负债	—	—	—	146,612.89	146,612.89
负债总计	—	—	—	255,848,620.27	255,848,620.27
利率敏感度缺口	877,185,971.87	240,052,880.60	1,436,354.00	1,796,807,611.60	2,915,482,818.07

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率上升25个基点	-67,353.78	-148,237.24
	市场利率下降25个基点	67,940.22	149,874.72

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的

风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围60-95%；现金、债券及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-40%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,775,964,861.8 3	68.94	2,045,354,835.0 6	70.15

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,775,964,861.83	68.94	2,045,354,835.06	70.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,788,603.00	—
	业绩比较基准下降5%	-1,788,603.00	—

注：于2015年12月31日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,775,964,861.83	68.71
	其中：股票	2,775,964,861.83	68.71
2	固定收益投资	224,722,000.00	5.56
	其中：债券	224,722,000.00	5.56
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—

4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	100,000,000.00	2.48
	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	627,081,222.04	15.52
7	其他各项资产	312,118,397.69	7.73
8	合计	4,039,886,481.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	358,652,499.96	8.91
C	制造业	1,532,294,312.66	38.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	278,350.00	0.01
E	建筑业	99,862,889.70	2.48
F	批发和零售业	78,057,014.14	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	5,152,000.00	0.13
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,273,923.20	1.60
J	金融业	377,868,821.20	9.38
K	房地产业	159,414,568.61	3.96
L	租赁和商务服务业	1,235,278.02	0.03
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	—
N	水利、环境和公共设施管理业	42,223,829.76	1.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,315,080.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	55,316,168.48	1.37

S	综合	—	—
	合计	2,775,964,861.83	68.94

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	56,886,868	268,506,016.96	6.67
2	000063	中兴通讯	9,708,973	139,226,672.82	3.46
3	000001	平安银行	15,632,107	135,999,330.90	3.38
4	600048	保利地产	15,062,006	129,985,111.78	3.23
5	000625	长安汽车	9,098,825	124,380,937.75	3.09
6	002262	恩华药业	5,376,138	108,329,180.70	2.69
7	000928	中钢国际	7,876,599	99,087,615.42	2.46
8	300370	安控科技	8,562,612	97,271,272.32	2.42
9	002709	天赐材料	1,889,285	94,515,321.60	2.35
10	600055	华润万东	5,266,593	92,481,373.08	2.30
11	601166	兴业银行	5,929,906	90,371,767.44	2.24
12	002603	以岭药业	5,519,264	87,811,490.24	2.18
13	002554	惠博普	8,363,220	60,215,184.00	1.50
14	603699	纽威股份	3,378,717	59,938,439.58	1.49
15	600633	浙报传媒	3,599,712	54,139,668.48	1.34
16	002050	三花股份	5,078,229	49,004,909.85	1.22
17	601208	东材科技	5,606,905	47,826,899.65	1.19
18	000333	美的集团	1,973,050	46,800,746.00	1.16
19	600958	东方证券	2,696,573	45,329,392.13	1.13
20	002376	新北洋	3,358,445	44,868,825.20	1.11
21	600718	东软集团	2,446,935	44,827,849.20	1.11
22	300360	炬华科技	1,945,389	44,024,153.07	1.09
23	300190	维尔利	2,430,848	42,223,829.76	1.05

24	600305	恒顺醋业	3,629,348	41,810,088.96	1.04
25	002250	联化科技	2,785,082	39,882,374.24	0.99
26	601318	中国平安	1,000,000	32,040,000.00	0.80
27	603338	浙江鼎力	684,550	31,557,755.00	0.78
28	002736	国信证券	1,625,905	28,046,861.25	0.70
29	002419	天虹商场	2,221,336	26,567,178.56	0.66
30	000758	中色股份	3,400,000	26,350,000.00	0.65
31	601058	赛轮金宇	7,426,100	24,803,174.00	0.62
32	300203	聚光科技	910,476	24,036,566.40	0.60
33	002727	一心堂	951,620	23,790,500.00	0.59
34	600885	宏发股份	769,696	23,637,364.16	0.59
35	002285	世联行	2,991,377	23,302,826.83	0.58
36	300406	九强生物	1,067,360	22,894,872.00	0.57
37	002658	雪迪龙	1,226,991	21,337,373.49	0.53
38	600196	复星医药	1,109,804	21,108,472.08	0.52
39	300334	津膜科技	1,131,222	20,418,557.10	0.51
40	601933	永辉超市	4,771,634	19,706,848.42	0.49
41	601601	中国太保	666,937	18,033,976.48	0.45
42	601328	交通银行	2,990,500	16,836,515.00	0.42
43	300026	红日药业	936,543	16,286,482.77	0.40
44	300224	正海磁材	690,000	15,642,300.00	0.39
45	603818	曲美家居	896,300	14,340,800.00	0.36
46	002294	信立泰	494,864	13,460,300.80	0.33
47	601965	中国汽研	1,395,740	13,413,061.40	0.33
48	300365	恒华科技	291,886	13,353,784.50	0.33
49	000400	许继电气	835,850	12,905,524.00	0.32
50	002236	大华股份	978,250	12,815,075.00	0.32
51	300446	乐凯新材	246,084	12,107,332.80	0.30
52	300485	赛升药业	232,663	10,809,522.98	0.27
53	300303	聚飞光电	1,095,290	10,208,102.80	0.25

54	300006	莱美药业	1,134,047	9,820,847.02	0.24
55	600332	白云山	324,917	8,005,954.88	0.20
56	603939	益丰药房	245,018	7,992,487.16	0.20
57	002563	森马服饰	683,977	7,407,470.91	0.18
58	002454	松芝股份	396,910	7,215,823.80	0.18
59	300045	华力创通	367,539	7,038,371.85	0.17
60	600720	祁连山	1,000,000	6,710,000.00	0.17
61	002080	中材科技	302,111	6,066,388.88	0.15
62	002244	滨江集团	897,900	6,015,930.00	0.15
63	601006	大秦铁路	800,000	5,152,000.00	0.13
64	002518	科士达	193,093	4,804,153.84	0.12
65	600036	招商银行	260,180	4,553,150.00	0.11
66	300227	光韵达	186,667	4,440,807.93	0.11
67	002214	大立科技	324,942	4,006,534.86	0.10
68	601169	北京银行	360,000	3,733,200.00	0.09
69	601899	紫金矿业	1,062,700	3,581,299.00	0.09
70	300309	吉艾科技	260,280	3,456,518.40	0.09
71	601579	会稽山	209,900	2,967,986.00	0.07
72	601398	工商银行	658,700	2,924,628.00	0.07
73	601799	星宇股份	60,930	2,791,812.60	0.07
74	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.07
75	600699	均胜电子	65,678	2,515,467.40	0.06
76	002383	合众思壮	68,749	2,463,276.67	0.06
77	600050	中国联通	636,160	2,423,769.60	0.06
78	603686	龙马环卫	60,000	2,188,200.00	0.05
79	600079	人福医药	100,000	1,677,000.00	0.04
80	600298	安琪酵母	75,000	1,338,000.00	0.03
81	300015	爱尔眼科	36,000	1,315,080.00	0.03
82	300291	华录百纳	50,000	1,176,500.00	0.03
83	600138	中青旅	60,000	1,159,200.00	0.03

84	300395	菲利华	30,000	803,400.00	0.02
85	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
86	000639	西王食品	50,000	706,000.00	0.02
87	000733	振华科技	29,150	655,875.00	0.02
88	002056	横店东磁	38,542	655,214.00	0.02
89	600460	士兰微	82,020	650,418.60	0.02
90	603800	道森股份	20,000	615,000.00	0.02
91	300440	运达科技	17,400	586,554.00	0.01
92	002664	信质电机	16,385	557,417.70	0.01
93	000951	中国重汽	56,000	535,360.00	0.01
94	000858	五粮液	13,000	422,890.00	0.01
95	300124	汇川技术	19,999	387,980.60	0.01
96	002405	四维图新	15,000	369,000.00	0.01
97	603520	司太立	4,360	230,992.80	0.01
98	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
99	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	—
100	300332	天壕环境	20,000	187,400.00	—
101	600309	万华化学	10,000	173,000.00	—
102	002484	江海股份	9,920	151,280.00	—
103	601313	江南嘉捷	9,313	134,852.24	—
104	600325	华发股份	10,000	110,700.00	—
105	600008	首创股份	20,000	77,800.00	—
106	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	—
107	002712	思美传媒	2,001	76,078.02	—
108	300515	三德科技	1,354	63,461.98	—
109	300497	富祥股份	523	61,557.10	—
110	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	—
111	002799	环球印务	1,080	47,131.20	—
112	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	—
113	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	—

114	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	—
115	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	—
116	601368	绿城水务	1,000	13,150.00	—
117	300394	天孚通信	250	10,202.50	—
118	300520	科大国创	926	9,306.30	—
119	002805	丰元股份	971	5,631.80	—
120	002428	云南锗业	93	1,597.74	—

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	600028	中国石化	146,449,129.50	5.02
2	000928	中钢国际	89,449,707.63	3.07
3	600048	保利地产	81,308,294.71	2.79
4	600055	华润万东	69,179,291.73	2.37
5	600958	东方证券	66,399,832.24	2.28
6	002736	国信证券	65,298,756.64	2.24
7	000063	中兴通讯	60,662,244.68	2.08
8	600718	东软集团	57,655,971.17	1.98
9	300370	安控科技	55,357,379.65	1.90
10	601377	兴业证券	52,990,153.19	1.82
11	002554	惠博普	46,777,642.56	1.60
12	300360	炬华科技	45,897,119.06	1.57
13	002262	恩华药业	45,697,537.24	1.57
14	002050	三花股份	44,626,283.13	1.53
15	002603	以岭药业	44,554,312.25	1.53
16	002376	新北洋	44,246,005.50	1.52
17	603699	纽威股份	43,508,232.23	1.49
18	300190	维尔利	42,467,049.34	1.46

19	600633	浙报传媒	41,581,439.75	1.43
20	601058	赛轮金宇	41,020,174.60	1.41

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	600104	上汽集团	92,143,360.95	3.16
2	600699	均胜电子	70,317,932.11	2.41
3	300365	恒华科技	59,545,179.18	2.04
4	601313	江南嘉捷	58,607,590.38	2.01
5	300006	莱美药业	54,773,385.93	1.88
6	600885	宏发股份	54,720,050.37	1.88
7	601377	兴业证券	53,540,099.18	1.84
8	601601	中国太保	52,342,297.84	1.80
9	002736	国信证券	46,225,833.47	1.59
10	601799	星宇股份	45,351,879.81	1.56
11	600048	保利地产	44,259,399.24	1.52
12	300370	安控科技	43,995,774.33	1.51
13	600460	士兰微	41,427,410.51	1.42
14	600718	东软集团	40,225,460.23	1.38
15	601211	国泰君安	39,941,836.12	1.37
16	601058	赛轮金宇	39,302,547.28	1.35
17	600633	浙报传媒	34,873,354.67	1.20
18	002554	惠博普	34,403,594.36	1.18
19	002664	信质电机	31,870,410.31	1.09
20	000400	许继电气	26,694,471.45	0.92

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,262,494,559.25
卖出股票的收入（成交）总额	1,536,928,703.52

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	224,722,000.00	5.58
	其中：政策性金融债	224,722,000.00	5.58
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	224,722,000.00	5.58

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	150207	15国开07	1,100,000	112,486,000.00	2.79
2	150415	15农发15	500,000	51,415,000.00	1.28
3	150212	15国开12	500,000	50,625,000.00	1.26
4	150409	15农发09	100,000	10,196,000.00	0.25

注：本基金本报告期末只持有四只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1609	中证500股指期货1609合约	17	19,958,680.00	2,623,984.00	
IC1612	中证500股指期货1612合约	15	16,968,600.00	1,749,960.00	
IF1609	沪深300股指期货1609合约	5	4,565,400.00	230,640.00	
公允价值变动总额合计(元)					4,604,584.00
股指期货投资本期收益(元)					4,171,136.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					4,604,584.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货代替一部分现货仓位。本报告期间，股指期货大幅贴水，我们选择保持一定比例的股指期货长仓，一方面获取比较确定的超额收益，另一方面提升组合流动性。

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**

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未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	10,027,126.09
2	应收证券清算款	296,977,743.23
3	应收股利	—
4	应收利息	1,902,523.52
5	应收申购款	3,211,004.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	312,118,397.69

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	002709	天赐材料	92,766,821.60	2.30	非公开发行股票

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
6,326	599,455.27	3,477,257,765.2 4	91.70%	314,896,252.55	8.30%

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	2,933,350.84	0.0774%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年5月21日)基金份额总额	2,281,152,885.80
本报告期期初基金份额总额	2,683,287,471.21
本报告期基金总申购份额	1,818,259,218.30
减：本报告期基金总赎回份额	709,392,671.72
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	3,792,154,017.79

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金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

(1) 基金管理人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人于2016年5月10日发布公告，经泓德基金管理有限公司董事会审议，聘任温永鹏先生为公司副总经理。

公司已根据相关法律法规要求，在指定媒体公开披露了公司人员的变更信息，并已在监管机构备案。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金托管人的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

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	559,295,064.13	14.73%	397,827.68	14.17%	—
华创证券	2	2,283,969,930.24	60.15%	1,624,581.13	57.87%	—
平安证券	2	348,844,715.50	9.19%	248,131.72	8.84%	—
中国民族证券	1	72,383,515.13	1.91%	51,485.35	1.83%	—
中信建投证券	2	532,696,957.43	14.03%	485,446.87	17.29%	—
方正证券	1	—	—	—	—	—
西藏同信证券	2	—	—	—	—	—
湘财证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
东北证券	39,028.01	0.14%	450,000,000	62.5%	—	—
华创证券	21,979,660.1	77.47%	270,000,000	37.5%	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
中国民族证券	—	—	—	—	—	—
中信建投证券	6,353,319.1	22.39%	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
西藏同信证券	—	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
中金公司	—	—	—	—	—	—

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究部、投资部等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评

价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每季度对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

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	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金因指数熔断实施调整开放时间的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-04
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金因指数熔断实施调整开放时间的公告0107	公司官网、中国证券报	2016-01-07
3	关于旗下部分基金增加申万宏源证券为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
4	泓德基金关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-08
5	泓德优选成长混合型证券投资基金2015年第4季度报告	公司官网、中国证券报	2016-01-21
6	泓德基金管理有限公司关于调整旗下基金最低赎回份额和最低保有份额限制的公告	公司官网、中国证券报	2016-01-29
7	关于旗下基金增加杭州数米基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-02-29
8	关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-01

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
9	泓德优选成长混合型证券投资基金2015年年度报告	公司官网、中国证券报	2016-03-28
10	泓德优选成长混合型证券投资基金2015年年度报告摘要	公司官网、中国证券报	2016-03-28
11	关于泓德优选成长混合型证券投资基金增加国泰君安证券为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-13
12	关于旗下基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-14
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金调整申购费率结构的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-19
14	泓德优选成长混合型证券投资基金2016年第1季度报告	公司官网、中国证券报	2016-04-20
15	关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-21
16	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金通过直销柜台向养老金客户实施特定费率的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-27
17	关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-28
18	关于旗下部分基金在首创证券有限责任公司开通定投和转换业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
19	关于旗下基金增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投业务并参	公司官网、中国证券报	2016-05-16

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
	与其费率优惠的公告		
20	关于旗下基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
21	关于旗下基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
22	关于旗下基金增加珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
23	泓德基金管理有限公司关于旗下基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定投业务的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-12
24	关于旗下基金增加北京创金启富投资管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25
25	关于旗下基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德优选成长混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德优选成长混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德优选成长混合型证券投资基金招募说明书》；

- 4、《泓德优选成长混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、.基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务热线：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日