

民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资 基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：民生加银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 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 24 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 2016 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53

§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动	54
§10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	民生加银城镇化混合
基金主代码	000408
交易代码	000408
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 12 日
基金管理人	民生加银基金管理有限公司
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	122,451,799.95 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过相对灵活的资产配置，重点投资于在城镇化建设过程中将有突出贡献并因此受益的上市公司，在充分控制基金资产风险和保持基金资产流动性的基础上，追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	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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、中期票据、资产支持证券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。本基金持有受益于城镇化建设的股票净值及债券净值不低于本基金非现金基金资产的 80%。 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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，预期风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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		民生加银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林海	田青
	联系电话	0755-23999888	010-67595096
	电子邮箱	linhai@msjfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-388	010-67595096

传真	0755-23999800	010-66275853
注册地址	深圳市福田区益田路西、福 中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区益田路西、福 中路北新世界商务中心 4201. 4202-B. 4203-B. 4204	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518026	100033
法定代表人	万青元	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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网 网址	http://www.msjyfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	民生加银基金管理有限公司	深圳市福田区益田路新世界商务中 心 42 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-9,361,287.02
本期利润	-3,478,842.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0274
本期加权平均净值利润率	-1.38%
本期基金份额净值增长率	-4.66%
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	120,251,329.85
期末可供分配基金份额利润	0.9820
期末基金资产净值	255,288,422.87
期末基金份额净值	2.085
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	114.71%

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

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

③期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

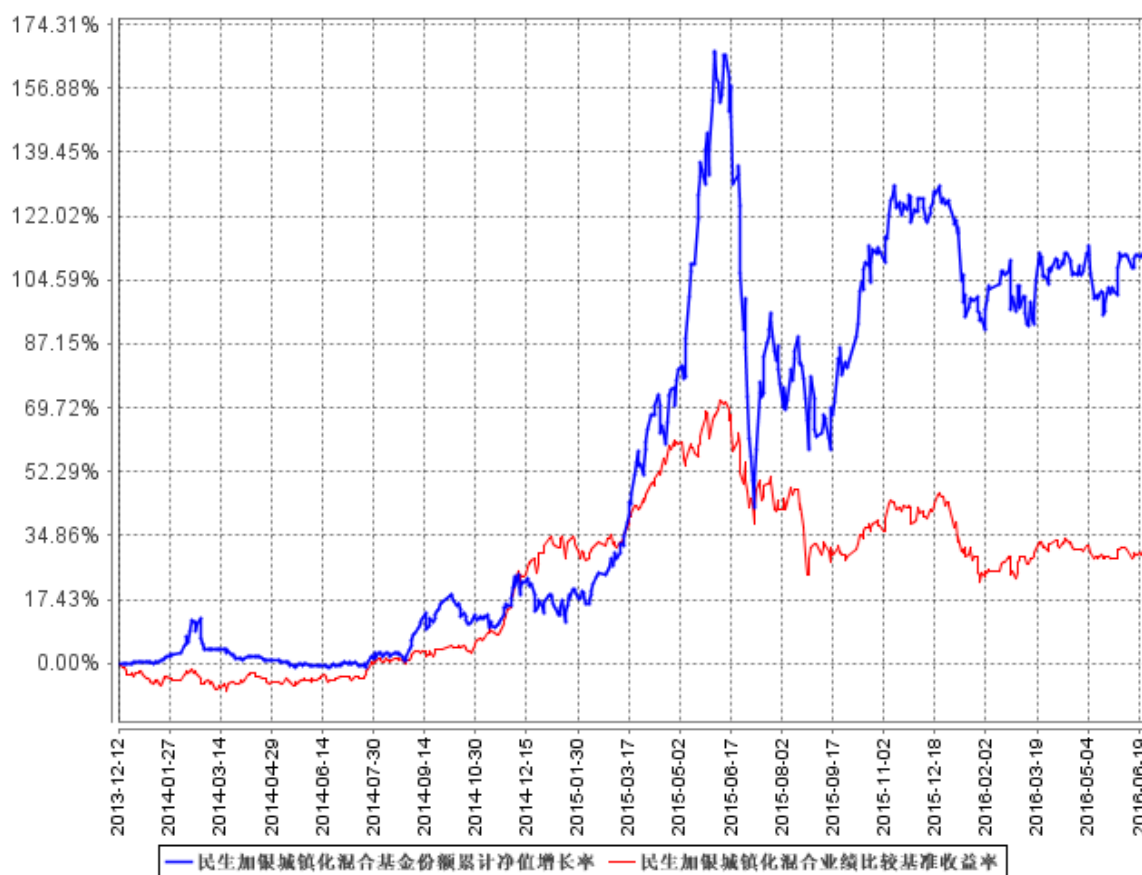
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.22%	0.62%	-0.04%	0.59%	3.26%	0.03%
过去三个月	3.32%	1.16%	-1.17%	0.61%	4.49%	0.55%
过去六个月	-4.66%	1.64%	-8.45%	1.11%	3.79%	0.53%
过去一年	7.47%	2.31%	-15.28%	1.38%	22.75%	0.93%
自基金合同生效起至今	114.71%	1.94%	31.09%	1.15%	83.62%	0.79%

注：业绩比较基准=沪深 300 指数收益率*60%+中证国债指数收益率*40%

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

民生加银城镇化混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2013 年 12 月 12 日生效，本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

民生加银基金管理有限公司（以下简称“公司”）是由中国民生银行股份有限公司、加拿大皇家银行和三峡财务有限责任公司共同发起设立的中外合资基金管理公司。经中国证监会 [2008]1187 号文批准，于 2008 年 11 月 3 日在深圳正式成立，2012 年注册资本增加至 3 亿元人民币。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司共管理 29 只开放式基金：民生加银品牌蓝筹灵活配置混合型证

券投资基金、民生加银增强收益债券型证券投资基金、民生加银精选混合型证券投资基金、民生加银稳健成长混合型证券投资基金、民生加银内需增长混合型证券投资基金、民生加银景气行业混合型证券投资基金、民生加银中证内地资源主题指数型证券投资基金、民生加银信用双利债券型证券投资基金、民生加银红利回报灵活配置混合型证券投资基金、民生加银平稳增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金增利货币市场基金、民生加银积极成长混合型发起式证券投资基金、民生加银家盈理财 7 天债券型证券投资基金、民生加银转债优选债券型证券投资基金、民生加银家盈理财月度债券型证券投资基金、民生加银策略精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银岁岁增利定期开放债券型证券投资基金、民生加银平稳添利定期开放债券型证券投资基金、民生加银现金宝货币市场基金、民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金、民生加银优选股票型证券投资基金、民生加银新动力灵活配置混合型证券投资基金、民生加银研究精选灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新战略灵活配置混合型证券投资基金、民生加银新收益债券型证券投资基金、民生加银和鑫债券型证券投资基金、民生加银量化中国灵活配置混合型证券投资基金、民生加银鑫瑞债券型证券投资基金、民生加银现金添利货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡锋亮	民生加银精选混合、民生加银稳健成长混合、民生加银内需增长混合、民生加银城镇化混合的基金经理	2013年12月12日	-	10年	英国格拉斯哥大学国际金融硕士。自 2006 年起在金鹰基金先后从事行业研究、策略研究、投资助理及交易主管等相关工作；2011 年 1 月加入民生加银基金管理有限公司，曾任基金经理助理。
黄一明	民生加银品牌蓝筹混合、民生加银城镇化混合、民生加银优选股票的基金经理	2013年12月12日	-	9年	工商管理硕士。自 2007 年起历任交银施罗德基金公司投资研究部行业研究员，平安大华基金管理公司投资研究部基金经理助理及高级研究员；自 2012 年 5 月加盟民生加银基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从《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，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。本报告期内，基金运作整体合法合规，无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

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在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成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在 2015 年底大幅降低了股票仓位，回避了今年年初股票市场的两次“熔断式”下跌。但比较遗憾的是后续加仓抄底的时间略微早了一些，导致净值还是出现了一定幅度的回撤。出于对经济复苏的预判，我们在春节后调整了仓位结构，增加了受益于供给侧改革和经济复苏方向的传统周期行业。在仓位选择上，本基金始终注意保持仓位控制的灵活性，市场恐慌时候适当加仓，

市场短期亢奋时候则调减组合仓位。进入 2 季度，我们判断市场短期的系统性风险不大，加大了股票资产配置力度。6 月上旬我们开始降低仓位，并提高组合中行业主题的集中度。总体对于 2 季度下半段，我们的策略都是偏保守的。这里必须说明的是，由于市场对经济基本面和产业结构调整敏感度，导致轮动速度加快，本基金在仓位和组合结构上的调整也会相对灵活。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.085 元，本报告期内份额净值增长率为-4.66%，同期业绩比较基准收益率为-8.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年，我们认为市场在监管政策的指引下，风格将会出现较大的变化。价值投资和真实成长的标的将会更加受到市场青睐。预期在 3 季度的调整之后，市场有望在 4 季度的某个时候迎来较好的阶段性投资时点。本基金将努力做好准备，储备相关投资品种。投资的方向将集中在消费升级和制造升级这两个大方向。行业上将关注新能源汽车、品牌消费品、电气设备、新材料等。

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基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括分管运营的公司领导、督察长、投资总监、运营管理部、交易部、研究部、投资部、固定收益部、监察稽核部、风险管理部各部门负责人及其指定的相关人员。研究部参加人员应包含金融工作小组及相关行业研究员。分管运营的公司领导任估值小组组长。且基金经理不参与其管理基金的相关估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期可不进行利润分配。

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，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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	118,999,246.21	143,465,220.92
结算备付金		3,926,202.28	5,443,118.02
存出保证金		1,187,583.45	702,421.63
交易性金融资产	6.4.7.2	99,740,928.35	36,738,067.01
其中：股票投资		99,740,928.35	36,738,067.01
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		35,799,928.17	12,673,097.70
应收利息	6.4.7.5	34,805.91	31,449.67
应收股利		-	-
应收申购款		1,262,939.50	351,462.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		260,951,633.87	199,404,837.62
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		-	-
应付赎回款		3,139,588.17	1,722,294.70
应付管理人报酬		320,112.25	259,979.67
应付托管费		53,352.05	43,329.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,068,763.83	3,603,457.66
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	81,394.70	246,483.06
负债合计		5,663,211.00	5,875,545.03
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	122,451,799.95	88,492,194.93
未分配利润	6.4.7.10	132,836,622.92	105,037,097.66
所有者权益合计		255,288,422.87	193,529,292.59
负债和所有者权益总计		260,951,633.87	199,404,837.62

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 122,451,799.95 份，基金份额净值人民币 2.085 元。

6.2 利润表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		8,855,584.16	35,316,453.69

1.利息收入		471,602.06	60,580.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	429,769.43	58,921.30
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		41,832.63	1,659.27
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,204,821.52	61,018,969.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,759,801.37	60,805,778.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	445,020.15	213,191.03
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,882,444.30	-25,990,044.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	296,716.28	226,948.32
减：二、费用		12,334,426.88	2,659,449.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,871,475.82	761,740.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	311,912.62	126,956.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,064,393.31	1,696,246.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	86,645.13	74,504.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,478,842.72	32,657,004.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,478,842.72	32,657,004.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	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	88,492,194.93	105,037,097.66	193,529,292.59

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,478,842.72	-3,478,842.72
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)	33,959,605.02	31,278,367.98	65,237,973.00
其中：1.基金申购款	152,987,409.68	151,034,831.21	304,022,240.89
2.基金赎回款	-119,027,804.66	-119,756,463.23	-238,784,267.89
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)	122,451,799.95	132,836,622.92	255,288,422.87
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	64,760,720.24	8,550,906.73	73,311,626.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	32,657,004.50	32,657,004.50
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)	1,598,416.28	21,160,569.08	22,758,985.36
其中：1.基金申购款	106,579,357.82	112,424,650.58	219,004,008.40
2.基金赎回款	-104,980,941.54	-91,264,081.50	-196,245,023.04
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)	66,359,136.52	62,368,480.31	128,727,616.83

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：

吴剑飞
基金管理人负责人

周吉人
主管会计工作负责人

洪锐珠
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2013]第 929 号《关于核准民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人民生加银基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2013 年 12 月 12 日正式生效，首次设立募集规模为 235,923,426.05 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为民生加银基金管理有限公司，注册登记机构为民生加银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、中期票据、资产支持证券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。本基金各类资产的投资比例为：股票、权证、股指期货等权益类资产占基金资产的 0%-95%；债券、货币市场工具、现金、中期票据、资产支持证券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不低于基金资产的 5%。本基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金持有受益于城镇化建设的股票净值及债券净值不低于本基金非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证国债指数收益率×40%。

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（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 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净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

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、增值税、企业所得税

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。

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, 免征营业税;

自 2016 年 5 月 1 日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点, 金融业纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税; 质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税; 买断式买入返售金融商品、同业存单及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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。

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。

6.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入, 由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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, 减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 减按 25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2015 年 9 月 8 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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	118,999,246.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	118,999,246.21

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	96,066,582.33	99,740,928.35	3,674,346.02
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	96,066,582.33	99,740,928.35	3,674,346.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

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**

本基金于本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本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	32,504.71
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,766.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	534.40
合计	34,805.91

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,068,763.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,068,763.83

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	11,777.88
预提费用	69,616.82
合计	81,394.70

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	88,492,194.93	88,492,194.93
本期申购	152,987,409.68	152,987,409.68
本期赎回(以“-”号填列)	-119,027,804.66	-119,027,804.66
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	122,451,799.95	122,451,799.95

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	96,157,035.11	8,880,062.55	105,037,097.66
本期利润	-9,361,287.02	5,882,444.30	-3,478,842.72
本期基金份额交易产生的变动数	33,455,581.76	-2,177,213.78	31,278,367.98
其中：基金申购款	142,090,433.39	8,944,397.82	151,034,831.21
基金赎回款	-108,634,851.63	-11,121,611.60	-119,756,463.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	120,251,329.85	12,585,293.07	132,836,622.92

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	367,140.09
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	53,167.96
其他	9,461.38
合计	429,769.43

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	3,439,798,989.45
减：卖出股票成本总额	3,438,039,188.08
买卖股票差价收入	1,759,801.37

6.4.7.13 债券投资收益

本基金于本期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本期无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	445,020.15
基金投资产生的股利收益	-
合计	445,020.15

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	5,882,444.30
——股票投资	5,882,444.30
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	5,882,444.30

6.4.7.18 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	290,092.66
转换费收入	6,623.62
合计	296,716.28

6.4.7.19 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	10,064,393.31
银行间市场交易费用	-
合计	10,064,393.31

6.4.7.20 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	19,890.78
信息披露费	49,726.04
其他费用	200.00
银行费用	10,828.31
债券帐户维护费	6,000.00
合计	86,645.13

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报

告。

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

截至本财务报表批准日，本基金无需作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
民生加银基金管理有限公司（“民生加银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、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

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均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1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	1,871,475.82	761,740.84
其中：支付销售机构的客户维护费	458,877.41	98,630.14

注：1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

2) 于 2016 年 6 月 30 日的应付基金管理费为人民币 320,112.25 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 259,979.67 元）。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	311,912.62	126,956.80

注：1) 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

2) 于 2016 年 6 月 30 日的应付基金托管费为人民币 53,352.05 元（2015 年 12 月 31 日：人民币 43,329.94 元）。

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

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金于本期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金于本期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	118,999,246.21	367,140.09	16,864,600.25	51,335.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金于本期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金于本期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金于本期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	1,972	25,596.56	25,596.56	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300176	鸿特精密	2016年4月27日	重大事项	30.20	-	-	156,950	4,973,512.00	4,739,890.00	-
300284	苏交科	2016年5月20日	重大事项	23.61	2016年8月10日	21.44	183,540	3,418,942.28	4,333,379.40	-
300061	康耐特	2016年5月5日	重大事项	28.84	2016年7月21日	31.56	108,300	2,588,678.00	3,123,372.00	-
000932	华菱钢铁	2016年3月28日	重大事项	3.95	2016年8月8日	4.35	701,600	2,657,397.11	2,771,320.00	-
002567	唐人神	2016年5月16日	重大事项	13.98	2016年7月29日	13.23	52,500	691,988.00	733,950.00	-
601611	中国核建	2016年6月30日	临时停牌	20.92	2016年7月1日	23.01	6,554	22,742.38	137,109.68	-
300507	苏奥传感	2016年6月30日	临时停牌	157.78	2016年7月5日	149.50	200	29,336.00	31,556.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事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

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事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奉行全面风险管理体系的建设，建立了以公募基金投资决策委员会和专户投资决策委员会核心的、由风险控制委员会、投资部、固定收益部、专户一部、专户二部、交易部、监察稽核部、研究部等相关业务部门构成的金融工具风险管理架构体系。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

于 2016 年 6 月 30 日及 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券投资。因此，本基金无重大的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于基金而言，体现在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相关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制的投资品种比例等。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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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	118,999,246.21	-	-	-	-	-	118,999,246.21
结算备付金	3,926,202.28	-	-	-	-	-	3,926,202.28
存出保证金	1,187,583.45	-	-	-	-	-	1,187,583.45
交易性金融资产	-	-	-	-	-	99,740,928.35	99,740,928.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	35,799,928.17	35,799,928.17
应收利息	-	-	-	-	-	34,805.91	34,805.91
应收申购款	-	-	-	-	-	1,262,939.50	1,262,939.50
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	124,113,031.94	-	-	-	-	136,838,601.93	260,951,633.87
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,139,588.17	3,139,588.17
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	320,112.25	320,112.25
应付托管费	-	-	-	-	-	53,352.05	53,352.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,068,763.83	2,068,763.83
其他负债	-	-	-	-	-	81,394.70	81,394.70
负债总计	-	-	-	-	-	5,663,211.00	5,663,211.00
利率敏感度缺口	124,113,031.94	-	-	-	-	131,175,390.93	255,288,422.87
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	143,465,220.92	-	-	-	-	-	143,465,220.92
结算备付金	5,443,118.02	-	-	-	-	-	5,443,118.02
存出保证金	702,421.63	-	-	-	-	-	702,421.63
交易性金融资产	-	-	-	-	-	36,738,067.01	36,738,067.01
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,673,097.70	12,673,097.70
应收利息	-	-	-	-	-	31,449.67	31,449.67
应收申购款	-	-	-	-	-	351,462.67	351,462.67
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	149,610,760.57	-	-	-	-	49,794,077.05	199,404,837.62
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,722,294.70	1,722,294.70
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	259,979.67	259,979.67
应付托管费	-	-	-	-	-	43,329.94	43,329.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,603,457.66	3,603,457.66
其他负债	-	-	-	-	-	246,483.06	246,483.06
负债总计	-	-	-	-	-	5,875,545.03	5,875,545.03
利率敏感度缺口	149,610,760.57	-	-	-	-	43,918,532.02	193,529,292.59

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日和 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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	99,740,928.35	39.07	36,738,067.01	18.98
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	99,740,928.35	39.07	36,738,067.01	18.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	1、本基金业绩比较基准上升 5%	13,979,941.70	12,723,792.28

	2、本基金业绩比较基准下降 5%	-13,979,941.70	-12,723,792.28
--	---------------------	----------------	----------------

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 83,816,215.63 元，划分为第二层次的余额为人民币 15,924,712.72 元，无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	99,740,928.35	38.22
	其中：股票	99,740,928.35	38.22
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	122,925,448.49	47.11
7	其他各项资产	38,285,257.03	14.67
8	合计	260,951,633.87	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,625,135.00	1.03
B	采矿业	5,799,329.00	2.27
C	制造业	66,454,390.07	26.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,972,134.68	1.16
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,818,912.18	1.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,444,955.92	3.70
L	租赁和商务服务业	2,042,136.00	0.80

M	科学研究和技术服务业	5,115,025.50	2.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	2,468,910.00	0.97
S	综合	-	-
	合计	99,740,928.35	39.07

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	000631	顺发恒业	1,939,416	9,444,955.92	3.70
2	000821	京山轻机	498,100	8,776,522.00	3.44
3	002436	兴森科技	286,610	6,531,841.90	2.56
4	002575	群兴玩具	535,000	6,072,250.00	2.38
5	600549	厦门钨业	203,800	6,054,898.00	2.37
6	600378	天科股份	341,200	5,203,300.00	2.04
7	300176	鸿特精密	156,950	4,739,890.00	1.86
8	300130	新国都	149,200	4,610,280.00	1.81
9	300284	苏交科	183,540	4,333,379.40	1.70
10	600213	亚星客车	314,121	4,008,183.96	1.57
11	600766	园城黄金	248,300	3,585,452.00	1.40
12	300061	康耐特	108,300	3,123,372.00	1.22
13	002755	东方新星	75,100	2,835,025.00	1.11
14	002205	国统股份	117,900	2,810,736.00	1.10
15	000932	华菱钢铁	701,600	2,771,320.00	1.09
16	300302	同有科技	85,059	2,761,865.73	1.08
17	600975	新五丰	286,900	2,625,135.00	1.03
18	601137	博威合金	189,100	2,535,831.00	0.99
19	002739	万达院线	30,900	2,468,910.00	0.97
20	002454	松芝股份	133,300	2,423,394.00	0.95
21	600678	四川金顶	200,700	2,422,449.00	0.95
22	002155	湖南黄金	168,100	2,213,877.00	0.87
23	002210	飞马国际	100,400	2,042,136.00	0.80
24	600315	上海家化	64,100	1,848,644.00	0.72

25	300371	汇中股份	33,000	1,187,340.00	0.47
26	300492	山鼎设计	15,200	761,520.00	0.30
27	002567	唐人神	52,500	733,950.00	0.29
28	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.06
29	601611	中国核建	6,554	137,109.68	0.05
30	002537	海立美达	3,200	97,280.00	0.04
31	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.03
32	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.02
33	300518	盛讯达	1,019	47,740.15	0.02
34	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
35	300507	苏奥传感	200	31,556.00	0.01
36	601127	小康股份	1,302	31,078.74	0.01
37	603958	哈森股份	2,037	29,536.50	0.01
38	601966	玲珑轮胎	1,972	25,596.56	0.01
39	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
40	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
41	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
42	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
43	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600549	厦门钨业	37,392,481.49	19.32
2	600111	北方稀土	36,101,002.63	18.65
3	600259	广晟有色	31,158,430.54	16.10
4	600010	包钢股份	27,752,761.50	14.34
5	000983	西山煤电	27,381,434.47	14.15
6	600188	兖州煤业	26,467,835.11	13.68
7	000937	冀中能源	26,064,390.88	13.47
8	000960	锡业股份	25,710,863.26	13.29
9	000831	*ST 五稀	24,890,012.25	12.86
10	601225	陕西煤业	24,797,044.49	12.81
11	601699	潞安环能	23,733,172.90	12.26

12	601600	中国铝业	22,642,945.00	11.70
13	002362	汉王科技	21,898,509.74	11.32
14	002446	盛路通信	19,903,940.75	10.28
15	600395	盘江股份	19,196,931.40	9.92
16	000751	锌业股份	18,332,139.43	9.47
17	300383	光环新网	17,794,401.07	9.19
18	002070	众和股份	17,370,729.92	8.98
19	600782	新钢股份	17,309,167.82	8.94
20	000060	中金岭南	16,906,804.15	8.74
21	600383	金地集团	16,891,146.35	8.73
22	000932	华菱钢铁	16,721,492.77	8.64
23	000878	云南铜业	16,643,766.13	8.60
24	000670	*ST 盈方	16,609,549.34	8.58
25	601118	海南橡胶	16,412,962.29	8.48
26	601688	华泰证券	16,214,042.31	8.38
27	601198	东兴证券	15,937,199.12	8.24
28	300302	同有科技	15,918,575.80	8.23
29	603019	中科曙光	15,793,328.16	8.16
30	000630	铜陵有色	15,734,597.00	8.13
31	000998	隆平高科	15,643,810.95	8.08
32	300084	海默科技	15,409,545.18	7.96
33	000807	云铝股份	15,345,970.07	7.93
34	300166	东方国信	15,276,186.32	7.89
35	600123	兰花科创	15,244,015.19	7.88
36	600005	武钢股份	15,159,556.18	7.83
37	600397	安源煤业	15,132,785.95	7.82
38	000709	河钢股份	14,751,017.68	7.62
39	600997	开滦股份	14,639,595.44	7.56
40	600392	盛和资源	14,561,743.30	7.52
41	002268	卫士通	14,501,180.00	7.49
42	002537	海立美达	14,467,678.06	7.48
43	002284	亚太股份	14,421,452.04	7.45
44	600497	驰宏锌锗	14,240,632.54	7.36
45	000933	*ST 神火	13,956,511.50	7.21
46	601898	中煤能源	13,891,535.00	7.18
47	600432	*ST 吉恩	13,882,241.80	7.17

48	600085	同仁堂	13,738,135.60	7.10
49	000402	金融街	13,660,199.75	7.06
50	002378	章源钨业	13,651,572.91	7.05
51	300168	万达信息	13,353,576.34	6.90
52	600598	北大荒	13,283,197.04	6.86
53	002090	金智科技	13,167,537.45	6.80
54	300096	易联众	12,963,792.66	6.70
55	300009	安科生物	12,869,293.01	6.65
56	300098	高新兴	12,863,827.00	6.65
57	000821	京山轻机	12,844,389.46	6.64
58	300252	金信诺	12,839,565.73	6.63
59	600109	国金证券	12,761,834.53	6.59
60	300310	宜通世纪	12,599,561.10	6.51
61	002518	科士达	12,564,879.55	6.49
62	000631	顺发恒业	12,361,654.35	6.39
63	600958	东方证券	12,337,219.50	6.37
64	002488	金固股份	12,234,830.32	6.32
65	600576	万家文化	12,135,649.84	6.27
66	002077	大港股份	12,062,938.90	6.23
67	601666	平煤股份	12,045,394.70	6.22
68	300299	富春通信	11,854,533.28	6.13
69	002113	天润数娱	11,792,428.35	6.09
70	002428	云南锗业	11,781,636.57	6.09
71	601101	昊华能源	11,773,721.09	6.08
72	002136	安纳达	11,538,731.13	5.96
73	601958	金钼股份	11,504,106.56	5.94
74	300144	宋城演艺	11,409,393.31	5.90
75	300452	山河药辅	11,401,336.66	5.89
76	000898	鞍钢股份	11,296,166.85	5.84
77	600157	永泰能源	11,231,234.89	5.80
78	000783	长江证券	11,078,644.40	5.72
79	300030	阳普医疗	10,978,921.20	5.67
80	600971	恒源煤电	10,974,101.19	5.67
81	600343	航天动力	10,969,627.55	5.67
82	600622	嘉宝集团	10,941,731.36	5.65
83	000786	北新建材	10,895,427.48	5.63

84	000975	银泰资源	10,890,693.02	5.63
85	603799	华友钴业	10,838,888.63	5.60
86	300001	特锐德	10,702,049.90	5.53
87	600688	上海石化	10,682,863.70	5.52
88	000018	神州长城	10,641,241.50	5.50
89	000959	首钢股份	10,637,316.95	5.50
90	600737	中粮屯河	10,593,488.80	5.47
91	000930	中粮生化	10,592,001.30	5.47
92	300236	上海新阳	10,566,818.42	5.46
93	000712	锦龙股份	10,472,121.45	5.41
94	300007	汉威电子	10,463,879.91	5.41
95	601788	光大证券	10,451,021.00	5.40
96	600160	巨化股份	10,433,964.99	5.39
97	000795	英洛华	10,388,710.23	5.37
98	300188	美亚柏科	10,377,858.97	5.36
99	002041	登海种业	10,351,151.96	5.35
100	601555	东吴证券	10,334,670.01	5.34
101	600231	凌钢股份	10,243,053.23	5.29
102	600546	*ST 山煤	10,197,955.43	5.27
103	600961	株冶集团	10,171,379.60	5.26
104	300401	花园生物	10,129,290.76	5.23
105	002769	普路通	10,044,273.50	5.19
106	300101	振芯科技	9,983,206.73	5.16
107	002500	山西证券	9,915,362.35	5.12
108	002364	中恒电气	9,910,723.73	5.12
109	300486	东杰智能	9,860,142.50	5.09
110	603993	洛阳钼业	9,819,140.50	5.07
111	600348	阳泉煤业	9,794,544.27	5.06
112	600117	西宁特钢	9,770,006.60	5.05
113	300170	汉得信息	9,590,921.43	4.96
114	002128	露天煤业	9,587,604.00	4.95
115	300379	东方通	9,585,288.00	4.95
116	601918	*ST 新集	9,310,989.03	4.81
117	300097	智云股份	9,287,634.00	4.80
118	002407	多氟多	9,194,798.50	4.75
119	002673	西部证券	9,088,335.22	4.70

120	600061	国投安信	9,066,415.25	4.68
121	300088	长信科技	9,064,269.28	4.68
122	600569	安阳钢铁	9,055,706.50	4.68
123	600019	宝钢股份	9,004,329.21	4.65
124	600206	有研新材	8,982,568.00	4.64
125	002224	三力士	8,978,465.49	4.64
126	300384	三联虹普	8,967,284.20	4.63
127	600030	中信证券	8,820,533.50	4.56
128	600403	大有能源	8,801,240.04	4.55
129	300369	绿盟科技	8,776,575.90	4.54
130	002103	广博股份	8,755,142.21	4.52
131	300359	全通教育	8,697,794.00	4.49
132	002601	佰利联	8,688,312.50	4.49
133	600022	山东钢铁	8,660,956.06	4.48
134	002019	亿帆鑫富	8,658,329.96	4.47
135	600808	马钢股份	8,654,420.24	4.47
136	000761	本钢板材	8,648,715.40	4.47
137	600595	中孚实业	8,600,766.00	4.44
138	002001	新和成	8,587,481.48	4.44
139	600699	均胜电子	8,436,518.00	4.36
140	600303	曙光股份	8,362,618.10	4.32
141	002439	启明星辰	8,285,626.37	4.28
142	600648	外高桥	8,260,432.90	4.27
143	300276	三丰智能	8,245,865.14	4.26
144	300481	濮阳惠成	8,214,920.72	4.24
145	000779	三毛派神	8,188,408.94	4.23
146	002114	罗平锌电	8,061,256.13	4.17
147	300229	拓尔思	8,013,197.15	4.14
148	002299	圣农发展	8,000,559.96	4.13
149	601003	柳钢股份	7,968,753.01	4.12
150	300341	麦迪电气	7,945,227.50	4.11
151	002590	万安科技	7,858,348.00	4.06
152	000552	靖远煤电	7,857,699.00	4.06
153	002273	水晶光电	7,811,041.17	4.04
154	300347	泰格医药	7,800,146.47	4.03
155	300211	亿通科技	7,761,263.22	4.01

156	300176	鸿特精密	7,721,435.34	3.99
157	600871	石化油服	7,682,550.00	3.97
158	002562	兄弟科技	7,603,557.00	3.93
159	000750	国海证券	7,592,828.68	3.92
160	600433	冠豪高新	7,574,362.29	3.91
161	600963	岳阳林纸	7,572,988.34	3.91
162	600702	沱牌舍得	7,523,235.59	3.89
163	000629	*ST 钒钛	7,514,599.00	3.88
164	002104	恒宝股份	7,443,422.00	3.85
165	600552	凯盛科技	7,409,751.20	3.83
166	300085	银之杰	7,378,948.22	3.81
167	300078	思创医惠	7,367,618.54	3.81
168	002145	中核钛白	7,209,967.14	3.73
169	000926	福星股份	7,153,500.00	3.70
170	600108	亚盛集团	7,136,833.56	3.69
171	000151	中成股份	7,126,918.31	3.68
172	300458	全志科技	7,100,507.46	3.67
173	002385	大北农	7,023,883.00	3.63
174	300083	劲胜精密	7,015,465.76	3.63
175	600988	赤峰黄金	7,003,609.06	3.62
176	300008	天海防务	6,898,122.07	3.56
177	600176	中国巨石	6,852,484.70	3.54
178	600148	长春一东	6,836,062.24	3.53
179	600777	新潮能源	6,818,067.85	3.52
180	600399	抚顺特钢	6,789,046.00	3.51
181	601005	重庆钢铁	6,788,903.00	3.51
182	600307	酒钢宏兴	6,762,935.00	3.49
183	002626	金达威	6,604,605.96	3.41
184	002007	华兰生物	6,582,368.12	3.40
185	600213	亚星客车	6,580,802.34	3.40
186	600999	招商证券	6,579,091.00	3.40
187	000523	广州浪奇	6,545,705.52	3.38
188	002202	金风科技	6,542,885.00	3.38
189	300222	科大智能	6,504,571.10	3.36
190	002371	七星电子	6,417,082.31	3.32
191	601377	兴业证券	6,386,329.10	3.30

192	000733	振华科技	6,363,572.45	3.29
193	600058	五矿发展	6,354,754.60	3.28
194	300065	海兰信	6,348,636.32	3.28
195	300339	润和软件	6,341,891.00	3.28
196	002575	群兴玩具	6,225,469.67	3.22
197	300081	恒信移动	6,215,208.48	3.21
198	600787	中储股份	6,155,475.18	3.18
199	000758	中色股份	6,115,625.00	3.16
200	000728	国元证券	6,115,040.84	3.16
201	002502	骅威文化	6,078,450.05	3.14
202	002155	湖南黄金	6,072,441.44	3.14
203	002184	海得控制	6,053,929.14	3.13
204	601689	拓普集团	6,037,809.40	3.12
205	300400	劲拓股份	6,020,744.48	3.11
206	600491	龙元建设	6,018,662.00	3.11
207	002056	横店东磁	6,007,616.00	3.10
208	300287	飞利信	5,982,682.00	3.09
209	000532	力合股份	5,955,816.81	3.08
210	600115	东方航空	5,911,616.00	3.05
211	601001	大同煤业	5,897,757.87	3.05
212	600172	黄河旋风	5,814,302.64	3.00
213	300228	富瑞特装	5,765,598.64	2.98
214	600126	杭钢股份	5,635,355.36	2.91
215	002519	银河电子	5,587,629.14	2.89
216	002458	益生股份	5,553,754.40	2.87
217	000031	中粮地产	5,522,309.45	2.85
218	002420	毅昌股份	5,504,619.13	2.84
219	002736	国信证券	5,503,506.25	2.84
220	600780	通宝能源	5,478,823.77	2.83
221	002448	中原内配	5,434,462.46	2.81
222	300036	超图软件	5,405,489.00	2.79
223	300104	乐视网	5,389,491.00	2.78
224	300018	中元股份	5,367,572.20	2.77
225	300157	恒泰艾普	5,352,055.85	2.77
226	300017	网宿科技	5,316,122.92	2.75
227	002355	兴民钢圈	5,309,012.00	2.74

228	002395	双象股份	5,303,653.00	2.74
229	601718	际华集团	5,285,058.00	2.73
230	000778	新兴铸管	5,274,314.00	2.73
231	600866	*ST 星湖	5,272,013.00	2.72
232	300395	菲利华	5,251,385.78	2.71
233	002066	瑞泰科技	5,238,482.65	2.71
234	300100	双林股份	5,204,144.49	2.69
235	000022	深赤湾 A	5,199,787.40	2.69
236	002436	兴森科技	5,118,104.84	2.64
237	300270	中威电子	5,109,878.00	2.64
238	000688	建新矿业	5,098,573.95	2.63
239	600378	天科股份	5,086,128.68	2.63
240	600766	园城黄金	5,073,566.75	2.62
241	600876	洛阳玻璃	5,059,897.70	2.61
242	000858	五粮液	5,026,306.40	2.60
243	002782	可立克	5,022,659.00	2.60
244	600331	宏达股份	5,013,905.00	2.59
245	600697	欧亚集团	4,947,290.08	2.56
246	002353	杰瑞股份	4,944,943.77	2.56
247	300022	吉峰农机	4,838,068.25	2.50
248	000100	TCL 集团	4,823,390.00	2.49
249	002191	劲嘉股份	4,810,148.00	2.49
250	002230	科大讯飞	4,809,473.56	2.49
251	600422	昆药集团	4,796,243.27	2.48
252	002192	融捷股份	4,786,954.00	2.47
253	002609	捷顺科技	4,763,551.36	2.46
254	300130	新国都	4,736,648.00	2.45
255	002560	通达股份	4,730,436.00	2.44
256	002738	中矿资源	4,678,503.20	2.42
257	300202	聚龙股份	4,677,153.00	2.42
258	600073	上海梅林	4,666,898.00	2.41
259	300031	宝通科技	4,649,305.00	2.40
260	600179	*ST 黑化	4,624,282.00	2.39
261	300141	和顺电气	4,608,282.86	2.38
262	600694	大商股份	4,558,211.02	2.36
263	000012	南玻 A	4,547,377.00	2.35

264	300373	扬杰科技	4,515,947.00	2.33
265	000708	大冶特钢	4,513,192.50	2.33
266	000166	申万宏源	4,477,744.07	2.31
267	000410	沈阳机床	4,457,269.50	2.30
268	002321	华英农业	4,426,212.40	2.29
269	600887	伊利股份	4,419,965.40	2.28
270	300087	荃银高科	4,394,058.50	2.27
271	000701	厦门信达	4,371,638.76	2.26
272	000524	岭南控股	4,369,714.00	2.26
273	600809	山西汾酒	4,317,739.65	2.23
274	600017	日照港	4,275,318.00	2.21
275	600872	中炬高新	4,223,139.00	2.18
276	601908	京运通	4,220,822.96	2.18
277	601233	桐昆股份	4,212,823.00	2.18
278	601012	隆基股份	4,165,706.65	2.15
279	601333	广深铁路	4,161,061.00	2.15
280	601088	中国神华	4,153,554.17	2.15
281	300470	日机密封	4,143,834.00	2.14
282	002384	东山精密	4,115,992.28	2.13
283	600682	南京新百	4,114,468.00	2.13
284	600755	厦门国贸	4,050,774.94	2.09
285	002210	飞马国际	4,043,228.90	2.09
286	000713	丰乐种业	4,043,067.00	2.09
287	002020	京新药业	4,042,229.00	2.09
288	000687	华讯方舟	4,031,818.00	2.08
289	601336	新华保险	4,010,119.59	2.07
290	600306	*ST 商城	4,001,073.00	2.07
291	000090	天健集团	3,998,688.00	2.07
292	601628	中国人寿	3,993,863.20	2.06
293	300364	中文在线	3,980,091.50	2.06
294	002715	登云股份	3,978,668.40	2.06
295	601618	中国中冶	3,954,202.00	2.04
296	002177	御银股份	3,952,272.03	2.04
297	603609	禾丰牧业	3,951,866.00	2.04
298	000735	罗牛山	3,944,009.47	2.04
299	300191	潜能恒信	3,924,232.50	2.03

300	000050	深天马 A	3,921,255.42	2.03
301	002165	红宝丽	3,913,474.84	2.02
302	600141	兴发集团	3,898,583.43	2.01

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600111	北方稀土	35,173,231.22	18.17
2	600549	厦门钨业	31,007,960.25	16.02
3	600259	广晟有色	30,687,268.16	15.86
4	000983	西山煤电	27,402,586.23	14.16
5	600010	包钢股份	27,192,097.90	14.05
6	000937	冀中能源	26,624,548.40	13.76
7	600188	兖州煤业	26,597,714.44	13.74
8	000960	锡业股份	26,433,880.94	13.66
9	601225	陕西煤业	24,872,907.11	12.85
10	000831	*ST 五稀	24,680,009.52	12.75
11	601699	潞安环能	24,059,560.38	12.43
12	601600	中国铝业	22,355,438.17	11.55
13	002362	汉王科技	22,096,885.31	11.42
14	002446	盛路通信	19,938,351.43	10.30
15	600395	盘江股份	18,987,982.89	9.81
16	000751	锌业股份	18,571,901.48	9.60
17	300383	光环新网	18,275,171.52	9.44
18	002070	众和股份	17,443,179.96	9.01
19	000060	中金岭南	17,243,755.96	8.91
20	600782	新钢股份	16,922,265.64	8.74
21	600383	金地集团	16,905,664.25	8.74
22	000878	云南铜业	16,700,534.20	8.63
23	601198	东兴证券	16,442,113.20	8.50
24	300084	海默科技	16,183,295.88	8.36
25	601688	华泰证券	16,169,977.05	8.36
26	601118	海南橡胶	16,076,669.18	8.31
27	000998	隆平高科	15,907,573.00	8.22
28	000807	云铝股份	15,784,313.09	8.16

29	000630	铜陵有色	15,747,720.00	8.14
30	300166	东方国信	15,727,087.73	8.13
31	600123	兰花科创	15,069,341.07	7.79
32	600397	安源煤业	15,015,891.18	7.76
33	603019	中科曙光	14,958,421.56	7.73
34	600997	开滦股份	14,958,345.28	7.73
35	600497	驰宏锌锗	14,950,501.61	7.73
36	600005	武钢股份	14,896,861.22	7.70
37	002268	卫士通	14,786,579.02	7.64
38	000709	河钢股份	14,606,658.89	7.55
39	000670	*ST 盈方	14,603,898.38	7.55
40	000932	华菱钢铁	14,286,692.76	7.38
41	600392	盛和资源	14,267,566.46	7.37
42	002284	亚太股份	14,228,018.69	7.35
43	300168	万达信息	13,921,144.16	7.19
44	600432	*ST 吉恩	13,901,526.82	7.18
45	000933	*ST 神火	13,887,102.29	7.18
46	002537	海立美达	13,811,686.87	7.14
47	600085	同仁堂	13,743,647.98	7.10
48	601898	中煤能源	13,723,792.92	7.09
49	000402	金融街	13,709,428.46	7.08
50	600598	北大荒	13,559,493.61	7.01
51	002378	章源钨业	13,467,180.79	6.96
52	300302	同有科技	13,386,334.04	6.92
53	300252	金信诺	13,361,821.28	6.90
54	600109	国金证券	13,273,892.37	6.86
55	600576	万家文化	13,245,494.52	6.84
56	300009	安科生物	13,244,551.50	6.84
57	300096	易联众	13,107,766.54	6.77
58	300098	高新兴	13,070,776.97	6.75
59	002518	科士达	12,909,968.40	6.67
60	002113	天润数娱	12,751,864.64	6.59
61	002090	金智科技	12,692,406.28	6.56
62	300310	宜通世纪	12,687,178.47	6.56
63	300401	花园生物	12,481,019.33	6.45
64	600958	东方证券	12,346,605.06	6.38
65	601666	平煤股份	12,102,737.23	6.25
66	002488	金固股份	11,895,704.72	6.15

67	300452	山河药辅	11,792,251.73	6.09
68	002428	云南锗业	11,750,992.50	6.07
69	300299	富春通信	11,739,611.37	6.07
70	300144	宋城演艺	11,660,357.30	6.03
71	601958	金钼股份	11,636,508.63	6.01
72	601101	昊华能源	11,540,976.69	5.96
73	000783	长江证券	11,327,040.65	5.85
74	000975	银泰资源	11,285,117.37	5.83
75	000898	鞍钢股份	11,223,138.27	5.80
76	002077	大港股份	11,217,552.43	5.80
77	002136	安纳达	11,121,112.68	5.75
78	603799	华友钴业	11,041,823.33	5.71
79	600157	永泰能源	11,007,023.98	5.69
80	000018	神州长城	10,938,250.30	5.65
81	300486	东杰智能	10,937,343.64	5.65
82	300001	特锐德	10,896,229.08	5.63
83	600971	恒源煤电	10,888,492.13	5.63
84	300007	汉威电子	10,855,772.51	5.61
85	600343	航天动力	10,841,251.40	5.60
86	300236	上海新阳	10,718,313.80	5.54
87	601788	光大证券	10,706,307.16	5.53
88	300030	阳普医疗	10,689,077.00	5.52
89	601555	东吴证券	10,683,547.00	5.52
90	000712	锦龙股份	10,599,673.16	5.48
91	002769	普路通	10,596,658.52	5.48
92	600622	嘉宝集团	10,564,266.98	5.46
93	000959	首钢股份	10,519,219.46	5.44
94	000795	英洛华	10,418,666.22	5.38
95	000786	北新建材	10,412,423.40	5.38
96	600688	上海石化	10,259,467.69	5.30
97	600737	中粮屯河	10,244,298.70	5.29
98	002041	登海种业	10,241,240.65	5.29
99	300101	振芯科技	10,165,212.99	5.25
100	000930	中粮生化	10,129,330.15	5.23
101	300097	智云股份	10,119,162.42	5.23
102	002364	中恒电气	10,094,586.87	5.22
103	600231	凌钢股份	10,071,895.93	5.20
104	300188	美亚柏科	10,051,692.50	5.19

105	600160	巨化股份	10,037,498.40	5.19
106	600348	阳泉煤业	10,015,330.25	5.18
107	600546	*ST 山煤	10,014,877.83	5.17
108	300170	汉得信息	9,903,665.70	5.12
109	600961	株冶集团	9,854,207.93	5.09
110	603993	洛阳钼业	9,828,808.94	5.08
111	002500	山西证券	9,810,354.00	5.07
112	600117	西宁特钢	9,754,022.83	5.04
113	300088	长信科技	9,732,553.00	5.03
114	002128	露天煤业	9,667,944.00	5.00
115	002673	西部证券	9,564,567.80	4.94
116	600061	国投安信	9,487,126.86	4.90
117	300379	东方通	9,450,222.00	4.88
118	002407	多氟多	9,409,412.00	4.86
119	600403	大有能源	9,111,037.03	4.71
120	002224	三力士	9,085,544.59	4.69
121	601918	*ST 新集	9,083,095.00	4.69
122	600569	安阳钢铁	9,013,612.40	4.66
123	300384	三联虹普	9,013,386.66	4.66
124	600019	宝钢股份	9,009,520.35	4.66
125	300369	绿盟科技	8,981,804.66	4.64
126	600030	中信证券	8,902,804.78	4.60
127	600303	曙光股份	8,819,566.28	4.56
128	300276	三丰智能	8,794,071.63	4.54
129	300359	全通教育	8,697,289.74	4.49
130	300481	濮阳惠成	8,684,447.00	4.49
131	600206	有研新材	8,675,402.44	4.48
132	600022	山东钢铁	8,673,985.98	4.48
133	600595	中孚实业	8,668,596.00	4.48
134	000761	本钢板材	8,640,069.41	4.46
135	600808	马钢股份	8,616,600.85	4.45
136	600699	均胜电子	8,585,924.70	4.44
137	002001	新和成	8,512,570.71	4.40
138	002114	罗平锌电	8,498,413.35	4.39
139	002019	亿帆鑫富	8,436,762.76	4.36
140	002439	启明星辰	8,370,302.14	4.33
141	300229	拓尔思	8,365,110.84	4.32
142	002273	水晶光电	8,313,094.75	4.30

143	002103	广博股份	8,233,271.10	4.25
144	002601	佰利联	8,205,470.28	4.24
145	000779	三毛派神	8,161,443.80	4.22
146	300211	亿通科技	8,112,695.22	4.19
147	600648	外高桥	8,035,989.44	4.15
148	000552	靖远煤电	7,969,333.02	4.12
149	002590	万安科技	7,960,907.42	4.11
150	601003	柳钢股份	7,914,107.92	4.09
151	000066	长城电脑	7,878,565.00	4.07
152	000750	国海证券	7,788,912.98	4.02
153	002562	兄弟科技	7,621,361.48	3.94
154	300341	麦迪电气	7,540,527.95	3.90
155	300085	银之杰	7,539,796.58	3.90
156	300078	思创医惠	7,528,094.74	3.89
157	300458	全志科技	7,496,289.39	3.87
158	600702	沱牌舍得	7,434,709.95	3.84
159	300347	泰格医药	7,364,890.15	3.81
160	600963	岳阳林纸	7,362,241.00	3.80
161	000629	*ST 钒钛	7,338,537.00	3.79
162	300222	科大智能	7,253,359.69	3.75
163	600552	凯盛科技	7,248,319.84	3.75
164	300008	天海防务	7,245,720.96	3.74
165	600871	石化油服	7,236,573.00	3.74
166	600108	亚盛集团	7,200,940.01	3.72
167	002145	中核钛白	7,177,565.82	3.71
168	600433	冠豪高新	7,158,259.20	3.70
169	002299	圣农发展	7,137,385.36	3.69
170	600777	新潮能源	7,098,863.38	3.67
171	002385	大北农	7,070,191.50	3.65
172	600988	赤峰黄金	6,959,174.20	3.60
173	300081	恒信移动	6,927,001.00	3.58
174	000151	中成股份	6,883,683.31	3.56
175	601005	重庆钢铁	6,836,753.38	3.53
176	300065	海兰信	6,817,612.00	3.52
177	600999	招商证券	6,785,120.35	3.51
178	300339	润和软件	6,770,965.96	3.50
179	600307	酒钢宏兴	6,734,076.45	3.48
180	601377	兴业证券	6,708,279.00	3.47

181	600399	抚顺特钢	6,688,759.06	3.46
182	002202	金风科技	6,637,557.00	3.43
183	600172	黄河旋风	6,594,706.04	3.41
184	300083	劲胜精密	6,554,277.96	3.39
185	002626	金达威	6,538,082.79	3.38
186	600176	中国巨石	6,498,895.12	3.36
187	600148	长春一东	6,493,206.44	3.36
188	000733	振华科技	6,489,236.73	3.35
189	002782	可立克	6,437,055.68	3.33
190	002104	恒宝股份	6,436,470.02	3.33
191	000728	国元证券	6,416,658.50	3.32
192	002007	华兰生物	6,408,646.04	3.31
193	600058	五矿发展	6,335,544.76	3.27
194	000926	福星股份	6,252,336.50	3.23
195	002502	骅威文化	6,231,755.21	3.22
196	000523	广州浪奇	6,181,243.11	3.19
197	002184	海得控制	6,157,335.00	3.18
198	000532	力合股份	6,156,110.20	3.18
199	300228	富瑞特装	6,070,529.95	3.14
200	300400	劲拓股份	6,021,455.10	3.11
201	002458	益生股份	5,957,676.55	3.08
202	600115	东方航空	5,944,066.02	3.07
203	000758	中色股份	5,893,156.07	3.05
204	002371	七星电子	5,889,778.47	3.04
205	600787	中储股份	5,888,110.66	3.04
206	600491	龙元建设	5,791,160.82	2.99
207	002736	国信证券	5,743,632.92	2.97
208	002056	横店东磁	5,727,618.56	2.96
209	601689	拓普集团	5,682,751.13	2.94
210	002519	银河电子	5,671,818.02	2.93
211	002420	毅昌股份	5,647,765.99	2.92
212	300287	飞利信	5,640,194.98	2.91
213	600213	亚星客车	5,639,209.54	2.91
214	300036	超图软件	5,636,371.62	2.91
215	601001	大同煤业	5,614,649.90	2.90
216	002448	中原内配	5,601,380.50	2.89
217	300104	乐视网	5,592,541.16	2.89
218	300017	网宿科技	5,556,838.79	2.87

219	600126	杭钢股份	5,525,611.46	2.86
220	300018	中元股份	5,518,155.24	2.85
221	000821	京山轻机	5,445,297.60	2.81
222	601718	际华集团	5,432,246.00	2.81
223	300100	双林股份	5,427,193.86	2.80
224	002395	双象股份	5,407,462.37	2.79
225	600780	通宝能源	5,388,211.17	2.78
226	300157	恒泰艾普	5,298,736.04	2.74
227	000031	中粮地产	5,290,518.38	2.73
228	300395	菲利华	5,282,824.50	2.73
229	002355	兴民钢圈	5,246,158.12	2.71
230	000778	新兴铸管	5,225,381.00	2.70
231	300270	中威电子	5,102,610.24	2.64
232	600141	兴发集团	5,083,347.98	2.63
233	000688	建新矿业	5,081,613.80	2.63
234	002066	瑞泰科技	5,036,980.15	2.60
235	002353	杰瑞股份	5,031,416.70	2.60
236	600331	宏达股份	5,019,946.84	2.59
237	600866	*ST 星湖	5,010,194.00	2.59
238	600697	欧亚集团	5,005,044.93	2.59
239	000858	五粮液	4,994,229.49	2.58
240	002230	科大讯飞	4,980,057.00	2.57
241	600073	上海梅林	4,966,942.00	2.57
242	300031	宝通科技	4,930,518.24	2.55
243	002191	劲嘉股份	4,905,665.00	2.53
244	002560	通达股份	4,895,556.93	2.53
245	000022	深赤湾 A	4,892,308.37	2.53
246	002192	融捷股份	4,847,553.66	2.50
247	000012	南玻 A	4,839,471.66	2.50
248	000100	TCL 集团	4,832,231.86	2.50
249	600179	*ST 黑化	4,802,242.44	2.48
250	002609	捷顺科技	4,797,104.02	2.48
251	300202	聚龙股份	4,789,185.00	2.47
252	600876	洛阳玻璃	4,786,691.28	2.47
253	002738	中矿资源	4,769,780.23	2.46
254	000410	沈阳机床	4,750,652.18	2.45
255	000166	申万宏源	4,687,065.96	2.42
256	300373	扬杰科技	4,666,390.07	2.41

257	000911	南宁糖业	4,589,784.00	2.37
258	600422	昆药集团	4,578,706.80	2.37
259	000890	法尔胜	4,524,232.11	2.34
260	300022	吉峰农机	4,519,699.15	2.34
261	000708	大冶特钢	4,498,585.85	2.32
262	300141	和顺电气	4,493,735.50	2.32
263	600694	大商股份	4,460,067.80	2.30
264	000701	厦门信达	4,404,001.00	2.28
265	300087	荃银高科	4,353,157.17	2.25
266	600887	伊利股份	4,327,263.59	2.24
267	601908	京运通	4,300,992.75	2.22
268	000687	华讯方舟	4,280,489.00	2.21
269	300470	日机密封	4,267,361.16	2.21
270	002177	御银股份	4,238,374.22	2.19
271	601233	桐昆股份	4,236,275.15	2.19
272	601012	隆基股份	4,235,495.95	2.19
273	002321	华英农业	4,197,710.50	2.17
274	600809	山西汾酒	4,190,871.87	2.17
275	000713	丰乐种业	4,167,952.30	2.15
276	600755	厦门国贸	4,147,091.00	2.14
277	600306	*ST 商城	4,145,706.00	2.14
278	000524	岭南控股	4,101,741.50	2.12
279	601088	中国神华	4,083,858.03	2.11
280	002237	恒邦股份	4,082,061.00	2.11
281	601336	新华保险	4,068,272.00	2.10
282	002155	湖南黄金	4,043,069.00	2.09
283	600872	中炬高新	4,040,869.49	2.09
284	603901	永创智能	4,017,572.56	2.08
285	601628	中国人寿	4,011,097.04	2.07
286	002165	红宝丽	4,003,289.63	2.07
287	000776	广发证券	3,987,473.21	2.06
288	000050	深天马A	3,971,516.84	2.05
289	600784	鲁银投资	3,951,453.12	2.04
290	000090	天健集团	3,929,672.30	2.03
291	600429	三元股份	3,903,120.00	2.02
292	002020	京新药业	3,900,638.57	2.02
293	002384	东山精密	3,889,399.68	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,495,159,605.12
卖出股票收入（成交）总额	3,439,798,989.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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

本基金以避险保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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 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	1,187,583.45
2	应收证券清算款	35,799,928.17
3	应收股利	-
4	应收利息	34,805.91
5	应收申购款	1,262,939.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,285,257.03

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	300176	鸿特精密	4,739,890.00	1.86	重大事项
2	300284	苏交科	4,333,379.40	1.70	重大事项

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
715,660	171.10	8,638,585.10	7.05%	113,813,214.85	92.95%

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	494,948.38	0.4042%

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	10 [~] 50
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（2013年12月12日）基金份额总额	235,923,426.05
----------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	88,492,194.93
本报告期基金总申购份额	152,987,409.68
减:本报告期基金总赎回份额	119,027,804.66
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	122,451,799.95

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2016年3月16日,本基金管理人发布公告,解聘张力女士副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金所聘用的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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
中国国际金融 股份有限公司	2	909,619,214.91	13.12%	847,127.96	14.10%	-
国金证券股份 有限公司	1	860,787,603.31	12.41%	801,652.26	13.34%	-
中信建投证券 股份有限公司	2	755,169,816.43	10.89%	600,862.87	10.00%	-
华泰证券股份 有限公司	2	640,068,021.61	9.23%	489,908.32	8.15%	-
中国银河证券 股份有限公司	2	635,212,250.19	9.16%	537,058.19	8.94%	-
光大证券股份 有限公司	1	466,404,720.45	6.73%	434,363.51	7.23%	-
方正证券股份 有限公司	1	458,712,819.10	6.62%	326,284.74	5.43%	-
兴业证券股份 有限公司	1	380,819,306.85	5.49%	354,657.81	5.90%	-
中银国际证券 有限责任公司	2	350,516,593.23	5.06%	326,436.61	5.43%	-
东方证券股份 有限公司	1	312,237,206.77	4.50%	228,338.69	3.80%	-
招商证券股份 有限公司	1	237,186,670.62	3.42%	220,891.87	3.68%	-
国信证券股份 有限公司	1	229,141,047.87	3.30%	213,399.75	3.55%	-
海通证券股份 有限公司	1	217,222,806.68	3.13%	202,299.25	3.37%	-
长江证券股份 有限公司	1	170,603,809.37	2.46%	158,883.27	2.64%	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	121,314,308.14	1.75%	112,980.05	1.88%	-
申万宏源证券 有限公司	2	98,269,625.12	1.42%	69,899.45	1.16%	-
民生证券股份 有限公司	1	90,651,180.71	1.31%	84,423.45	1.40%	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-

安信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	25,500,000.00	7.42%	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份	-	-	163,500,000.00	47.57%	-	-

有限公司						
长江证券股份 有限公司						
国泰君安证券 股份有限公司						
申万宏源证券 有限公司						
民生证券股份 有限公司			154,700,000.00	45.01%		
英大证券有限 责任公司						
平安证券有限 责任公司						
国联证券股份 有限公司						
中国中投证券 有限责任公司						
安信证券股份 有限公司						
东兴证券股份 有限公司						
广发证券股份 有限公司						
中泰证券股份 有限公司						
中信证券股份 有限公司						

注：由于四舍五入的原因，百分比分项之和与合计可能有尾差。

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- ii 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；
- iii 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定； iv 经营行为规范，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；
- v 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 投研能力打分：由投资、研究、交易部相关人员对券商投研及综合能力进行打分，填写《券商

评价表》；

- ii 指定租用方案：由交易部根据评价结果，结合公司租用席位要求制定具体的席位租用方案；
- iii 公司领导审批：公司领导对席位租用方案进行审批或提供修改意见；
- iv 交易部洽谈：交易部指派专人就租用事宜等业务与券商一并进行洽谈，并起草相关书面协议；
- v 律师审议：席位租用协议交公司监察稽核部的律师进行法律审计；
- vi 交易部经办：席位租用协议生效后，由交易部专人与券商进行联系，具体办理租用手续；
- vii 连通测试：信息技术部接到交易部通知后，将联络券商技术人员对租用席位进行连通等方面的测试；
- viii 通知托管行：信息技术部测试通过后，应及时通知投资部、交易部及运营部，由运营部通知托管行有关席位的具体信息；
- ix 席位启用：交易席位正式使用，投资部、交易部、运营部有关人员须提前做好席位启用的准备工作。

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③本基金本期取消东海证券股份有限公司深圳交易单元作为本基金交易单元。

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	民生加银基金管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
2	民生加银基金管理有限公司由于交易所发生不可恢复熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	公司网站	2016 年 1 月 5 日
3	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 1 月 5 日
4	民生加银基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 8 日
5	民生加银城镇化灵活配置混合型	中国证券报、公司网	2016 年 1 月 21 日

	证券投资基金更新招募说明书及摘要（2015 年第 2 号）	站	
6	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
7	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
8	民生加银基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 3 月 16 日
9	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 1 日
10	民生加银基金管理有限公司关于调整通过招商银行借记卡在网上直销系统中办理业务的费率优惠公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 4 月 6 日
11	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2016 年 4 月 14 日
12	民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、公司网站	2016 年 4 月 20 日
13	民生加银基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2016 年 4 月 25 日

	公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告	券报、证券时报、证券日报、公司网站	
14	民生加银基金管理有限公司关于再次提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年4月25日
15	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2016年4月26日
16	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加民生银行直销银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年5月12日
17	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分已开通转换业务的开放式基金参加基金转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年5月31日
18	民生加银基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京广源达信投资管理有限公司为代销机构并开通基金定期定额投资和转换业务、同时参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016年6月15日
19	民生加银基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、证券时报、公司网站	2016年6月23日

20	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
21	民生加银基金管理有限公司关于调整开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站	2016 年 6 月 27 日

§ 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 中国证监会核准基金募集的文件；
- 2 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4 《民生加银城镇化灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5 法律意见书；
- 6 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的住所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

民生加银基金管理有限公司
2016 年 8 月 29 日