

**上投摩根双息平衡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：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本基金乃依据中港基金互认安排已获香港证券及期货事务监察委员会（下称“香港证监会”）之认可在香港公开发售的内地基金。香港证监会认可不等于对该产品作出推介或认许，亦不是对该产品的商业利弊或表现作出保证，更不代表该产品适合所有投资者，或认许该产品适合任何个别投资者或任何类别的投资者。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	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.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有债券投资明细.....	41
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.....	42
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
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 .....	45
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	45
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>47</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48
<b>13 补充披露</b> .....	<b>49</b>

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	上投摩根双息平衡混合型证券投资基金	
基金简称	上投摩根双息平衡混合	
基金主代码	373010	
交易代码	373010	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 月 26 日	
基金管理人	上投摩根基金管理有限公司	
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	2,996,616,422.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	上投摩根双息平衡混合 A	上投摩根双息平衡混合 H
下属分级基金的交易代码	373010	960005
报告期末下属分级基金的份额总额	2,996,521,495.21 份	94,927.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资高股息、高债息品种，获得稳定的股息与债息收入，同时把握资本利得机会以争取完全收益，力求为投资者创造绝对回报。
投资策略	本基金兼具红利与平衡基金特色，在借鉴 JP 摩根资产管理集团全球行之有效的投资理念基础上，充分结合国内资本市场的实际特征，通过严格的证券选择，深入挖掘股息与债息的获利机会，并积极运用战略资产配置（SAA）和战术资产配置（TAA）策略，动态优化投资组合，以实现进可攻、退可守的投资布局。在达到预期投资回报后，本基金适度锁定投资收益，及时调整资产配置比例以保证基金表现持续平稳。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，主要投资于红利股及相似条件下到期收益率较高的优良债券品种，风险高于债券基金和货币市场基金，低于股票基金，属于中低风险的证券投资基金产品。

### 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		上投摩根基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	胡迪	田青
	联系电话	021-38794888	010-67595096

负责人	电子邮箱	services@cifm.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-889-4888	010-67595096
传真		021-20628400	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		穆矢	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	《上海证券报》《中国证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cifm.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	上投摩根基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区富城路99号震旦国际大楼20楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）	
	上投摩根双息平衡混合 A	上投摩根双息平衡混合 H
本期已实现收益	-245,594,878.61	14,967.60
本期利润	-400,617,900.46	93,266.20
加权平均基金份额本期利润	-0.1319	0.0893
本期加权平均净值利润率	-16.01%	10.74%
本期基金份额净值增长率	-14.00%	12.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
	上投摩根双息平衡混合 A	上投摩根双息平衡混合 H
期末可供分配利润	-416,220,564.85	-12,004.04
期末可供分配基金份额利润	-0.1389	-0.1265
期末基金资产净值	2,580,300,930.36	82,923.02

期末基金份额净值	0.8611	0.8735
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
	上投摩根双息平衡混合 A	上投摩根双息平衡混合 H
基金份额累计净值增长率	289.55%	12.43%

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

2.上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（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

上投摩根双息平衡混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.53%	1.36%	0.04%	0.44%	4.49%	0.92%
过去三个月	2.39%	1.29%	-1.45%	0.47%	3.84%	0.82%
过去六个月	-14.00%	1.94%	-7.15%	0.85%	-6.85%	1.09%
过去一年	-16.97%	2.34%	-10.65%	1.11%	-6.32%	1.23%
过去三年	67.48%	1.78%	39.58%	0.86%	27.90%	0.92%
自基金合同生效起至今	289.55%	1.45%	142.89%	0.92%	146.66%	0.53%

上投摩根双息平衡混合 H

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	6.05%	1.39%	0.04%	0.44%	6.01%	0.95%
过去三个月	3.86%	1.30%	-1.45%	0.47%	5.31%	0.83%
自基金合同生效起至今	12.43%	1.35%	0.52%	0.48%	11.91%	0.87%

注：本基金的业绩比较基准于 2013 年 12 月 7 日由原“富时中国 150 红利指数收益率×45%+富时中国国债指数收益率×45%+同业存款利率×10%”变更为：“中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%”。

#### 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

上投摩根双息平衡混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006 年 4 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日)

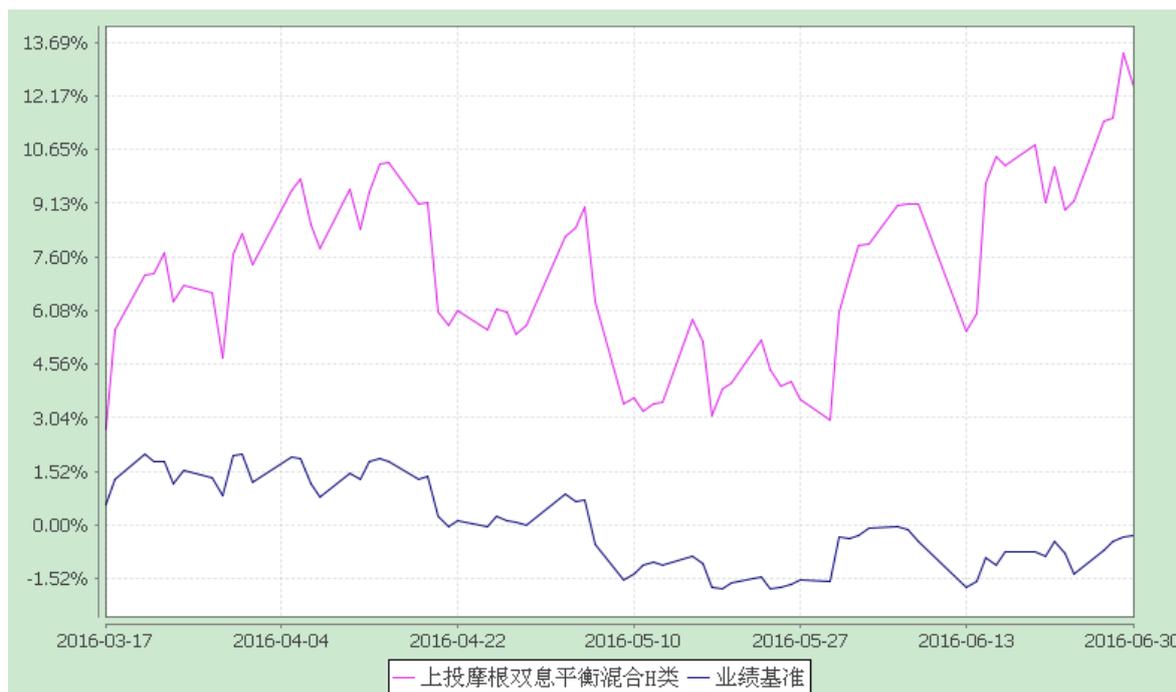
上投摩根双息平衡混合 A



注：本基金建仓期自 2006 年 4 月 26 日至 2006 年 10 月 25 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本基金合同生效日为 2006 年 4 月 26 日，图示时间段为 2006 年 4 月 26 日至 2016 年 6 月 30 日。

本基金自 2013 年 12 月 7 日起，将基金业绩比较基准由“富时中国 150 红利指数收益率×45%+富时中国国债指数收益率×45%+同业存款利率×10%”变更为“中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%”。

上投摩根双息平衡混合 H



注：本基金建仓期自 2006 年 4 月 26 日至 2006 年 10 月 25 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。本类份额生效日为 2016 年 3 月 17 日，图示时间段为 2016 年 3 月 17 日至 2016 年 6 月 30 日。

本基金自 2013 年 12 月 7 日起，将基金业绩比较基准由“富时中国 150 红利指数收益率×45%+富时中国国债指数收益率×45%+同业存款利率×10%”变更为“中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%”。

## 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

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2016 年 6 月底，公司管理的基金共有四十九只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资

基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上证 180 高贝塔交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金及上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙芳	本基金基金经理、投资二部投资总监、总经理助理	2011-12-08	-	13 年	华东师范大学经济学硕士，2003 年 7 月至 2006 年 10 月任华宝兴业基金行业研究员；自 2006 年 12 月起加入上投摩根基金管理有限公司，先后担任行业专家、基金经理助理，主要负责投资研究方面的工作。自 2011 年 12 月起担任上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金经理，2012 年 11 月起担任上投摩根核心优选混合型证券投资基金基金经理，2014 年 2 月至

					2015 年 7 月同时担任上投摩根核心成长股票型证券投资基金基金经理,自 2014 年 12 月起同时担任上投摩根行业轮动混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期和离任日期均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合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

#### 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

报告期内，本公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规和公司内部公平交易流程的各项要求，严格规范境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等活动，通过系统和人工相结合的方式进行交易执行和监控分析，以确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的环节均得到公平对待。

对于交易所市场投资活动，本公司执行集中交易制度，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量；对于银行间市场投资活动，本公司通过对手库控制和交易室询价机制，严格防范对手风险并检查价格公允性；对于申购投资行为，本公司遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

报告期内，通过对不同投资组合之间的收益率差异比较、对同向交易和反向交易的交易时机和交易价差监控分析，未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，未发现存在异常交易行为。

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%的情形：无。

#### 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 A 股开局不利连续大跌；回顾上半年，上证综指下跌 17.22%、创业板指下跌 17.92%、沪深 300 下跌 15.47%、中小板指下跌 17.88%。但是二季度以来，虽各个综合指数变化不大，但结构性行情明显、题材活跃。第二季度，锂电池指数上涨 30.8%、新材料指数上涨 25.9%、新能源汽车指数上涨 21.1%、稀土永磁指数上涨 34.5%、芯片国产化指数上涨 19.5%、传感器指数上涨 20%、能源互联网上涨 19.9%、次新股指数上涨 139%、oled 指数上涨 35.9%、特斯拉指数上涨 28.1%。

本基金去年底今年初未能及时降低仓位，损失较大；但二季度积极布局基本面高景气度的行业，例如新能源汽车产业链、oled、半导体等板块，取得了一定效果。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为-14.00%，同期业绩比较基准收益率为-7.15%。本基金 H 类基金份额净值增长率为 12.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，全球经济数据疲弱、地缘事件多发导致货币宽松预期再起，同时国内一季度信贷刺激后，部分经济数据略有企稳，但 5、6 月随着地产成交量增速回落，经济数据再现疲态，三、四季度货币政策大概率仍然相对宽松。预计三季度 A 股市场仍然会较为活跃，结构性机会迭出；关注中报、补涨、基本面拐点等多角度的投资机会，上游、军工、TMT、消费升级、新型能源后续可能多点开花。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金实际运作情况，本基金以 2015 年 12 月 18 日为收益分配基准日，于 2016 年 1 月 4 日实施收益分配，每 10 份基金份额派发红利 0.280 元，合计发放红利 79,617,400.72 元，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

#### 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

无。

### 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，本基金实施利润分配的金额为 79,617,400.72 元。

#### 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：上投摩根双息平衡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
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	61,222,801.33	190,769,676.58
结算备付金		8,762,736.88	16,877,488.79
存出保证金		1,069,000.83	1,555,988.90
交易性金融资产	6.4.7.2	2,559,389,028.69	2,848,463,914.77
其中：股票投资		1,904,584,318.59	2,064,570,796.65
基金投资		-	-
债券投资		654,804,710.10	783,893,118.12
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		-	34,050,431.52
应收利息	6.4.7.5	14,855,810.47	20,300,962.48
应收股利		-	-
应收申购款		375,342.54	6,697,181.41
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,645,674,720.74	3,118,715,644.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		-	88,600,000.00
应付证券清算款		42,744,742.58	86,688,592.64
应付赎回款		8,575,604.25	3,876,887.74
应付管理人报酬		3,140,231.32	3,644,756.66
应付托管费		523,371.89	607,459.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,617,593.38	6,819,450.17
应交税费		5,474,429.92	5,474,429.92
应付利息		-	5,551.01
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	214,894.02	416,939.84
负债合计		65,290,867.36	196,134,067.42
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,996,616,422.27	2,839,459,423.68
未分配利润	6.4.7.10	-416,232,568.89	83,122,153.35
所有者权益合计		2,580,383,853.38	2,922,581,577.03
负债和所有者权益总计		2,645,674,720.74	3,118,715,644.45

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,996,616,422.27 份，其中 A 类份额 2,996,521,495.21 份，H 类份额 94,927.06 份。A 类份额净值 0.8611 元，H 类份额净值 0.8735 元。

## 6.2 利润表

会计主体：上投摩根双息平衡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
<b>一、收入</b>		<b>-363,926,748.08</b>	<b>1,704,289,866.18</b>
1.利息收入		20,018,108.84	31,073,739.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	689,581.22	818,579.11
债券利息收入		19,324,227.61	30,239,644.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,300.01	15,516.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-229,202,478.31	1,056,228,470.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-228,888,705.81	1,015,375,861.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,873,769.39	33,884,251.17
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	4,559,996.89	6,968,358.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-154,944,723.25	614,423,480.50
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	202,344.64	2,564,174.96
<b>减：二、费用</b>		<b>36,597,886.18</b>	<b>56,057,484.49</b>
1. 管理人报酬		18,674,816.54	28,478,883.00
2. 托管费		3,112,469.41	4,746,480.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	14,095,782.67	15,216,642.32
5. 利息支出		471,911.76	7,378,860.52
其中：卖出回购金融资产支出		471,911.76	7,378,860.52
6. 其他费用	6.4.7.19	242,905.80	236,618.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-400,524,634.26</b>	<b>1,648,232,381.69</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-400,524,634.26</b>	<b>1,648,232,381.69</b>

**6.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：上投摩根双息平衡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）	2,839,459,423.68	83,122,153.35	2,922,581,577.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-400,524,634.26	-400,524,634.26
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）	157,156,998.59	-19,212,687.26	137,944,311.33
其中：1.基金申购款	404,056,845.28	-61,242,966.90	342,813,878.38
2.基金赎回款	-246,899,846.69	42,030,279.64	-204,869,567.05
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）	-	-79,617,400.72	-79,617,400.72
五、期末所有者权益（基金净值）	2,996,616,422.27	-416,232,568.89	2,580,383,853.38
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）	3,152,023,521.32	-23,175,870.54	3,128,847,650.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,648,232,381.69	1,648,232,381.69
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）	-408,392,107.28	-112,394,055.93	-520,786,163.21
其中：1.基金申购款	1,577,525,583.71	665,827,191.62	2,243,352,775.33
2.基金赎回款	-1,985,917,690.99	-778,221,247.55	-2,764,138,938.54
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）	-	-831,276,741.50	-831,276,741.50
五、期末所有者权益（基金净值）	2,743,631,414.04	681,385,713.72	3,425,017,127.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上投摩根双息平衡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”)证监基金字[2006]第 50 号《关于同意上投摩根双息平衡混合型证券投资基金募集的批复》核准，由上投摩根富林明基金管理有限公司(后更名为“上投摩根基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根双息平衡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人民币 6,434,951,616.90 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 41 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,435,738,977.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 787,360.60 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根双息平衡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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 20%-75%，债券为 20%-75%，权证的投资比例为基金净资产的 0-3%，并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。本基金重点投资对象为高股息、高债息品种，80%以上的非现金基金资产属于上述投资方向。考虑到国内股市发展现状，缺乏有效避险工具，本基金的基金管理人保留在极端市场情况中债券投资最高比例为 95%，股票投资最低比例为 0%的权利。本基金自 2013 年 12 月 7 日起，将基金业绩比较基准由“富时中国 150 红利指数收益率×45%+富时中国国债指数收益率×45%+同业存款利率×10%”变更为“中证红利指数收益率×45%+中债总指数收益率×55%”。

根据《关于上投摩根双息平衡混合型证券投资基金修改基金合同的公告》以及经修改的《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》，自 2015 年 7 月 24 日起，本基金根据基金销售地及

申购赎回费率的不同，将基金份额分为不同的类别。两类基金份额分设不同的基金代码，并分别公布基金份额净值。仅在中国大陆地区销售，并收取申购和赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额；仅在中国香港地区销售，并收取申购和赎回费用的基金份额，称为 H 类基金份额。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2016 年 8 月 26 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 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颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《上投摩根双息平衡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 年上半年度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 上半年度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告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对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，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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) 对于内地投资者持有的基金类别，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。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，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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

(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	61,222,801.33
定期存款	-
其他存款	-
合计	61,222,801.33

### 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	1,796,422,501.81	1,904,584,318.59	108,161,816.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	284,241,558.13	289,208,014.60
	银行间市场	361,082,532.04	365,596,695.50
	合计	645,324,090.17	654,804,710.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,441,746,591.98	2,559,389,028.69	117,642,436.71

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	15,533.09
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	3,943.20
应收债券利息	14,835,073.08
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	780.10
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	481.00
合计	14,855,810.47

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 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	4,616,743.38
银行间市场应付交易费用	850.00
合计	4,617,593.38

#### 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	25,905.11
预提费用	188,961.50
其他应付款	27.41
合计	214,894.02

#### 6.4.7.9 实收基金

上投摩根双息平衡混合 A

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	账面金额
上年度末	2,839,459,423.68	2,839,459,423.68
本期申购	402,959,744.44	402,959,744.44
本期赎回（以“-”号填列）	-245,897,672.91	-245,897,672.91
本期末	2,996,521,495.21	2,996,521,495.21

上投摩根双息平衡混合 H

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	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,097,100.84	1,097,100.84
本期赎回（以“-”号填列）	-1,002,173.78	-1,002,173.78
本期末	94,927.06	94,927.06

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**

上投摩根双息平衡混合 A

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	134,892,037.26	-51,769,883.91	83,122,153.35
本期利润	-245,594,878.61	-155,023,021.85	-400,617,900.46
本期基金份额交易产生的变动数	6,225,695.38	-25,333,112.40	-19,107,417.02
其中：基金申购款	-6,087,726.79	-54,916,279.89	-61,004,006.68
基金赎回款	12,313,422.17	29,583,167.49	41,896,589.66
本期已分配利润	-79,617,400.72	-	-79,617,400.72
本期末	-184,094,546.69	-232,126,018.16	-416,220,564.85

上投摩根双息平衡混合 H

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	-	-	-
本期利润	14,967.60	78,298.60	93,266.20
本期基金份额交易产生的变动数	-19,604.51	-85,665.73	-105,270.24
其中：基金申购款	-81,205.08	-157,755.14	-238,960.22

基金赎回款	61,600.57	72,089.41	133,689.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,636.91	-7,367.13	-12,004.04

#### 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	604,243.38
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	74,916.99
其他	10,420.85
合计	689,581.22

#### 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	4,564,296,096.15
减：卖出股票成本总额	4,793,184,801.96
买卖股票差价收入	-228,888,705.81

#### 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	416,822,524.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	409,628,233.11
减：应收利息总额	12,068,061.07
买卖债券差价收入	-4,873,769.39

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 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	4,559,996.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,559,996.89

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-154,944,723.25
——股票投资	-149,960,381.12
——债券投资	-4,984,342.13
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-154,944,723.25

#### 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	192,672.70
转换费收入	9,671.94
合计	202,344.64

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 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	14,094,732.67
银行间市场交易费用	1,050.00
合计	14,095,782.67

**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	139,235.46
银行费用	18,278.85
债券帐户维护费	27,000.00
律师费	8,565.45
其他	100.00
合计	242,905.80

**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**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

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

本报告期内，本基金的基金管理人接到股东上海国际信托有限公司（以下简称“上海信托”）通知，2016年3月15日上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）完成了收购上海信托股权的过户手续，工商变更登记手续已办理完毕，浦发银行成为上海信托控股股东，亦成为我公司关联方。

**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
上投摩根基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

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**

无。

**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	18,674,816.54	28,478,883.00
其中：支付销售机构的客户维护费	2,703,280.49	3,535,860.55

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，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 1.5% / 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	3,112,469.41	4,746,480.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，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**

无。

**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自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	2,677,390.51	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	2,677,390.51	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.09%	-

**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**

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年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	61,222,801.33	604,243.38	201,829,952.23	690,091.71

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**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合计	备注
1	2016-01-04	2016-01-04	0.280	33,442,154.15	46,175,246.57	79,617,400.72	-
合计			0.280	33,442,154.15	46,175,246.57	79,617,400.72	-

**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	注

002791	坚朗五金	2016-03-22	2017-03-22	网下中签	21.57	53.77	121,285.00	2,616,117.45	6,521,494.45	
002792	通宇通讯	2016-03-21	2017-03-21	网下中签	22.94	59.80	116,432.00	1,780,625.74	6,962,633.60	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	网下中签	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	网下中签	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	网下中签	12.98	12.98	15,341.00	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	网下中签	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-

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，从新股获配日至新股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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600330	天通股份	2016-05-23	重大事项	15.90	-	-	932,020.00	12,139,236.84	14,819,118.00	-
600556	慧球科技	2016-01-19	重大事项	16.19	2016-07-07	14.22	904,337.00	19,029,174.12	14,641,216.03	-
600576	万家文化	2016-04-11	重大事项	21.78	-	-	3,459,047.00	63,083,982.74	75,338,043.66	-
600734	实达集团	2016-04-20	重大事项	13.88	-	-	18,800.00	288,560.00	260,944.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项	20.92	2016-07-01	23.01	37,059.00	128,594.73	775,274.28	-
000638	万方发展	2016-01-05	重大事项	23.66	2016-07-25	24.75	441,600.00	11,168,227.00	10,448,256.00	-
000718	苏宁环球	2016-01-04	重大事项	9.91	2016-07-18	11.78	4,500,602.00	50,950,997.02	44,600,965.82	-
002663	普邦园林	2016-04-27	重大事项	7.36	-	-	954,578.00	6,464,751.27	7,025,694.08	-
300038	梅泰诺	2015-12-16	重大事项	50.58	-	-	100,500.00	5,596,250.99	5,083,290.00	-
300080	易成新能	2016-05-19	重大事项	7.76	-	-	1,606,638.00	15,427,803.70	12,467,510.88	-
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项	8.99	-	-	199,289.00	1,536,537.27	1,791,608.11	-
300351	永贵电器	2016-06-29	重大事项	33.93	2016-07-04	33.30	1,207,098.00	34,896,034.31	40,956,835.14	-
300427	红相电力	2016-06-13	重大事项	21.89	-	-	1,177,640.00	23,177,852.61	25,778,539.60	-

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

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律，法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；风险管理部负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监督和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
A-1	20,134,000.00	20,110,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	89,919,000.00	150,414,000.00
合计	110,053,000.00	170,524,000.00

注：未评级的债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	122,689,127.50	131,742,165.12
AAA 以下	298,490,582.60	397,710,953.00
未评级	123,572,000.00	83,916,000.00
合计	544,751,710.10	613,369,118.12

注：未评级的债券为政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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。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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016-6-30	3 个月以内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	61,222,801.33	-	-	-	-	61,222,801.33
结算备付金	8,762,736.88	-	-	-	-	8,762,736.88
存出保证金	1,069,000.83	-	-	-	-	1,069,000.83
交易性金融资产	71,585,050.00	250,378,684.80	332,840,975.30	-	1,904,584,318.59	2,559,389,028.69
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	14,855,810.47	14,855,810.47
应收申购款	3,329.15	-	-	-	372,013.39	375,342.54
资产总计	142,642,918.19	250,378,684.80	332,840,975.30	-	1,919,812,142.45	2,645,674,720.74
负债						
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	42,744,742.58	42,744,742.58
应付赎回款	-	-	-	-	8,575,604.25	8,575,604.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,140,231.32	3,140,231.32
应付托管费	-	-	-	-	523,371.89	523,371.89
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	4,617,593.38	4,617,593.38
应交税费	-	-	-	-	5,474,429.92	5,474,429.92
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	214,894.02	214,894.02
负债总计	-	-	-	-	65,290,867.36	65,290,867.36
利率敏感度缺口	142,642,918.19	250,378,684.80	332,840,975.30	-	1,854,521,275.09	2,580,383,853.38
上期末 2015/12/31	3 个月以内	3 个月至 1 年	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	190,769,676.58	-	-	-	-	190,769,676.58
结算备付金	16,877,488.79	-	-	-	-	16,877,488.79
存出保证金	1,555,988.90	-	-	-	-	1,555,988.90
交易性金融资产	74,729,000.00	208,762,950.00	424,133,970.12	76,267,198.00	2,064,570,796.65	2,848,463,914.77
应收证券清算款	-	-	-	-	34,050,431.52	34,050,431.52

应收利息	-	-	-	-	20,300,962.48	20,300,962.48
应收申购款	310,878.09	-	-	-	6,386,303.32	6,697,181.41
资产总计	284,243,032.36	208,762,950.00	424,133,970.12	76,267,198.00	2,125,308,493.97	3,118,715,644.45
负债						
卖出回购金融资产款	88,600,000.00	-	-	-	-	88,600,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	86,688,592.64	86,688,592.64
应付赎回款	-	-	-	-	3,876,887.74	3,876,887.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,644,756.66	3,644,756.66
应付托管费	-	-	-	-	607,459.44	607,459.44
应付交易费用	-	-	-	-	6,819,450.17	6,819,450.17
应交税费	-	-	-	-	5,474,429.92	5,474,429.92
应付利息	-	-	-	-	5,551.01	5,551.01
其他负债	-	-	-	-	416,939.84	416,939.84
负债总计	88,600,000.00	-	-	-	107,534,067.42	196,134,067.42
利率敏感度缺口	195,643,032.36	208,762,950.00	424,133,970.12	76,267,198.00	2,017,774,426.55	2,922,581,577.03

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：人民币万元）	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 285	增加约 384
	2. 市场利率上升 25 个基点	减少约 282	减少约 380

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，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。本基金投资组合中股票投资比例为 20%-75%，债券为 20%-75%，权证的投资比例为基金净资产的 0-3%。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	1,904,584,318.59	73.81	2,064,570,796.65	70.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>1,904,584,318.59</b>	<b>73.81</b>	<b>2,064,570,796.65</b>	<b>70.64</b>

#### 6.4.13.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证红利指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）

		本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.中证红利指数上升 5%	增加约 28,899	增加约 25,768
	2.中证红利指数下降 5%	减少约 28,899	减少约 25,768

#### 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,904,584,318.59	71.99
	其中：股票	1,904,584,318.59	71.99
2	固定收益投资	654,804,710.10	24.75
	其中：债券	654,804,710.10	24.75
	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	69,985,538.21	2.65
7	其他各项资产	16,300,153.84	0.62
8	合计	2,645,674,720.74	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	84,817,395.93	3.29

B	采矿业	42,606,335.41	1.65
C	制造业	1,249,921,888.74	48.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,359,872.52	0.29
E	建筑业	7,800,968.36	0.30
F	批发和零售业	107,514,957.58	4.17
G	交通运输、仓储和邮政业	75,890,628.68	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,586,151.47	4.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	126,969,165.98	4.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,958,026.10	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	14,623,213.50	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	21,454,676.15	0.83
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	38,081,038.17	1.48
S	综合	-	-
	合计	1,904,584,318.59	73.81

### 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	002477	雏鹰农牧	14,207,269	84,817,395.93	3.29
2	002245	澳洋顺昌	5,942,884	75,890,628.68	2.94
3	600576	万家文化	3,459,047	75,338,043.66	2.92
4	300340	科恒股份	839,884	66,544,009.32	2.58
5	002460	赣锋锂业	1,852,920	61,980,174.00	2.40
6	300252	金信诺	1,589,298	52,653,442.74	2.04
7	600667	太极实业	5,252,177	52,469,248.23	2.03
8	002329	皇氏集团	3,155,676	47,303,583.24	1.83
9	000718	苏宁环球	4,500,602	44,600,965.82	1.73
10	300034	钢研高纳	1,916,623	42,357,368.30	1.64
11	300351	永贵电器	1,207,098	40,956,835.14	1.59
12	300014	亿纬锂能	921,887	39,816,299.53	1.54

13	600240	华业资本	3,859,378	38,670,967.56	1.50
14	000673	当代东方	3,039,189	38,081,038.17	1.48
15	300161	华中数控	1,162,513	35,631,023.45	1.38
16	300073	当升科技	524,348	35,099,855.12	1.36
17	002466	天齐锂业	816,111	34,839,778.59	1.35
18	600686	金龙汽车	2,285,000	33,658,050.00	1.30
19	002158	汉钟精机	2,711,831	33,436,876.23	1.30
20	002108	沧州明珠	1,271,735	32,937,936.50	1.28
21	002048	宁波华翔	1,438,669	32,902,360.03	1.28
22	300316	晶盛机电	2,491,200	32,634,720.00	1.26
23	002450	康得新	1,906,954	32,608,913.40	1.26
24	002341	新纶科技	1,453,306	31,289,678.18	1.21
25	600775	南京熊猫	1,900,651	28,414,732.45	1.10
26	002741	光华科技	1,089,533	27,750,405.51	1.08
27	002345	潮宏基	2,724,860	26,649,130.80	1.03
28	300427	红相电力	1,177,640	25,778,539.60	1.00
29	300352	北信源	1,373,858	25,649,928.86	0.99
30	300322	硕贝德	1,134,051	24,382,096.50	0.94
31	002643	万润股份	467,600	23,791,488.00	0.92
32	603799	华友钴业	634,562	23,605,706.40	0.91
33	002502	骅威文化	897,455	22,077,393.00	0.86
34	600703	三安光电	1,079,445	21,556,516.65	0.84
35	600306	*ST 商城	1,695,712	21,467,713.92	0.83
36	603377	东方时尚	471,635	21,454,676.15	0.83
37	002097	山河智能	2,016,606	20,750,875.74	0.80
38	600232	金鹰股份	1,461,752	19,280,508.88	0.75
39	000558	莱茵体育	1,151,300	19,042,502.00	0.74
40	002690	美亚光电	735,846	16,953,891.84	0.66
41	600988	赤峰黄金	881,400	16,438,110.00	0.64
42	300366	创意信息	418,550	15,846,303.00	0.61
43	300098	高新兴	989,600	15,714,848.00	0.61
44	600330	天通股份	932,020	14,819,118.00	0.57
45	600556	慧球科技	904,337	14,641,216.03	0.57
46	600749	西藏旅游	773,715	14,623,213.50	0.57
47	600158	中体产业	818,624	14,530,576.00	0.56
48	000603	盛达矿业	757,300	13,843,444.00	0.54
49	300207	欣旺达	500,064	12,836,642.88	0.50
50	300080	易成新能	1,606,638	12,467,510.88	0.48
51	600547	山东黄金	316,751	12,324,781.41	0.48
52	002240	威华股份	881,155	11,772,230.80	0.46
53	300424	航新科技	171,332	11,602,603.04	0.45
54	300433	蓝思科技	402,700	11,323,924.00	0.44
55	002007	华兰生物	334,482	10,502,734.80	0.41
56	300302	同有科技	322,140	10,459,885.80	0.41

57	000638	万方发展	441,600	10,448,256.00	0.40
58	002077	大港股份	456,043	10,124,154.60	0.39
59	300469	信息发展	77,185	9,780,883.20	0.38
60	300458	全志科技	86,900	9,296,562.00	0.36
61	002156	通富微电	650,520	9,172,332.00	0.36
62	002547	春兴精工	823,900	9,112,334.00	0.35
63	300379	东方通	113,700	9,036,876.00	0.35
64	002340	格林美	1,024,403	8,984,014.31	0.35
65	600073	上海梅林	771,416	8,832,713.20	0.34
66	300369	绿盟科技	202,888	8,584,191.28	0.33
67	300371	汇中股份	234,224	8,427,379.52	0.33
68	300115	长盈精密	407,351	8,391,430.60	0.33
69	300183	东软载波	314,654	8,338,331.00	0.32
70	300337	银邦股份	1,024,300	8,061,241.00	0.31
71	002358	森源电气	517,191	7,980,257.13	0.31
72	002436	兴森科技	346,500	7,896,735.00	0.31
73	002153	石基信息	299,161	7,891,867.18	0.31
74	300212	易华录	253,200	7,537,764.00	0.29
75	000421	南京公用	735,252	7,359,872.52	0.29
76	002663	普邦园林	954,578	7,025,694.08	0.27
77	002792	通宇通讯	116,432	6,962,633.60	0.27
78	300278	华昌达	398,600	6,812,074.00	0.26
79	002791	坚朗五金	121,285	6,521,494.45	0.25
80	300327	中颖电子	99,499	5,316,231.57	0.21
81	300038	梅泰诺	100,500	5,083,290.00	0.20
82	601908	京运通	661,612	5,074,564.04	0.20
83	300365	恒华科技	102,181	4,674,780.75	0.18
84	002116	中国海诚	265,000	3,937,900.00	0.15
85	002326	永太科技	148,600	3,031,440.00	0.12
86	600423	柳化股份	300,000	2,010,000.00	0.08
87	300323	华灿光电	199,289	1,791,608.11	0.07
88	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.03
89	600734	实达集团	18,800	260,944.00	0.01
90	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
91	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
92	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
93	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
94	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
95	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
96	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
97	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
98	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
99	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
100	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00

101	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
102	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
103	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
104	603806	福斯特	51	2,661.69	0.00
105	300395	菲利华	1	26.78	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	600576	万家文化	81,969,752.41	2.80
2	002477	雏鹰农牧	77,581,903.55	2.65
3	002245	澳洋顺昌	63,510,682.19	2.17
4	603799	华友钴业	62,620,196.60	2.14
5	300034	钢研高纳	58,881,094.89	2.01
6	002460	赣锋锂业	58,845,099.97	2.01
7	600158	中体产业	58,233,650.44	1.99
8	300340	科恒股份	56,243,569.72	1.92
9	000673	当代东方	56,007,157.04	1.92
10	002668	奥马电器	55,100,336.12	1.89
11	600900	长江电力	53,645,134.04	1.84
12	002385	大北农	52,061,317.05	1.78
13	002341	新纶科技	51,308,748.62	1.76
14	002440	闰土股份	49,071,219.29	1.68
15	002001	新和成	49,059,344.26	1.68
16	002502	骅威文化	48,706,429.19	1.67
17	600232	金鹰股份	48,463,576.15	1.66
18	600988	赤峰黄金	46,277,783.89	1.58
19	600703	三安光电	46,110,857.75	1.58
20	300498	温氏股份	45,506,488.68	1.56

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

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	96,268,908.78	3.29

2	002477	雏鹰农牧	78,603,296.43	2.69
3	002668	奥马电器	59,532,886.46	2.04
4	002385	大北农	56,610,274.57	1.94
5	300098	高新兴	56,166,842.01	1.92
6	600900	长江电力	54,622,847.04	1.87
7	002001	新和成	53,589,686.48	1.83
8	002345	潮宏基	53,017,075.76	1.81
9	300498	温氏股份	50,669,683.20	1.73
10	603799	华友钴业	49,769,205.94	1.70
11	600547	山东黄金	47,638,346.49	1.63
12	002405	四维图新	46,912,288.65	1.61
13	002717	岭南园林	46,884,028.25	1.60
14	002273	水晶光电	44,123,650.42	1.51
15	300242	明家联合	44,050,294.01	1.51
16	002440	闰土股份	41,312,816.06	1.41
17	600158	中体产业	40,722,977.48	1.39
18	600216	浙江医药	39,633,660.84	1.36
19	600271	航天信息	39,619,943.77	1.36
20	600988	赤峰黄金	39,442,020.71	1.35

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

#### 7.4.3 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	4,783,158,705.02
卖出股票的收入（成交）总额	4,564,296,096.15

注：“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	213,491,000.00	8.27
	其中：政策性金融债	213,491,000.00	8.27

4	企业债券	342,848,528.10	13.29
5	企业短期融资券	20,134,000.00	0.78
6	中期票据	72,177,000.00	2.80
7	可转债（可交换债）	6,154,182.00	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	654,804,710.10	25.38

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有债券投资明细

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	140202	14 国开 02	500,000	53,445,000.00	2.07
2	101469008	14 华联 MTN001	300,000	30,600,000.00	1.19
3	160401	16 农发 01	300,000	29,994,000.00	1.16
4	160209	16 国开 09	300,000	29,949,000.00	1.16
5	1480008	14 滨高新	199,970	22,026,695.50	0.85
6	122736	12 石油 03	200,000	20,882,000.00	0.81
7	122593	12 衡城投	250,000	20,802,500.00	0.81
8	140208	14 国开 08	200,000	20,392,000.00	0.79
9	150408	15 农发 08	200,000	20,190,000.00	0.78
10	041566015	15 粤珠江 CP002	200,000	20,134,000.00	0.78
11	160204	16 国开 04	200,000	19,976,000.00	0.77
12	110227	11 国开 27	200,000	19,440,000.00	0.75
13	122672	12 西城投	210,000	13,395,900.00	0.52
14	122607	PR 渝地产	200,000	13,000,000.00	0.50
15	1480111	14 青岛莱西债	100,000	10,968,000.00	0.43
16	124496	13 丰城 02	100,000	10,896,000.00	0.42
17	124468	13 丰城 01	100,000	10,817,000.00	0.42
18	124349	13 福东海	100,000	10,593,000.00	0.41
19	101351015	13 南山集 MTN002	100,000	10,548,000.00	0.41
20	122786	11 联想债	100,000	10,492,000.00	0.41
21	1280208	12 甘公投债	100,000	10,429,000.00	0.40
22	1282470	12TCL 集 MTN1	100,000	10,421,000.00	0.40
23	101454051	14 兵器 MTN002	100,000	10,307,000.00	0.40
24	1282339	12 南山集 MTN3	100,000	10,301,000.00	0.40

25	111059	09 宿建投	100,000	10,147,000.00	0.39
26	130340	13 进出 40	100,000	10,105,000.00	0.39
27	122094	11 海正债	100,000	10,051,000.00	0.39
28	150416	15 农发 16	100,000	10,000,000.00	0.39
29	136090	15 绿地 02	100,000	9,838,000.00	0.38
30	122336	13 牡丹 01	94,500	9,742,950.00	0.38
31	1280462	12 大丰债	100,000	8,549,000.00	0.33
32	111057	09 尧城投	85,000	8,530,600.00	0.33
33	122323	14 凤凰债	80,000	8,340,000.00	0.32
34	122536	12 慈国控	100,000	8,286,000.00	0.32
35	124014	12 筑住投	100,000	8,281,000.00	0.32
36	122905	10 南昌债	80,000	8,216,800.00	0.32
37	112080	12 万向债	80,000	8,190,400.00	0.32
38	1380137	13 武地产债	100,000	7,822,000.00	0.30
39	124075	12 淮建投	100,000	7,709,000.00	0.30
40	122743	12 华发集	130,000	6,884,800.00	0.27
41	124346	13 乳国资	65,000	6,861,400.00	0.27
42	124743	14 银城投	60,000	6,358,800.00	0.25
43	110031	航信转债	55,800	6,154,182.00	0.24
44	124037	12 渝江北	70,000	5,813,500.00	0.23
45	124438	13 冶城投	50,000	5,368,500.00	0.21
46	122700	12 来宾债	50,120	5,355,823.20	0.21
47	112148	12 光电债	50,000	5,085,500.00	0.20
48	122623	12 旅建债	55,000	4,559,500.00	0.18
49	122726	12 柳东债	60,000	3,821,400.00	0.15
50	124386	13 新沂债	35,000	3,617,600.00	0.14
51	122621	12 赣城债	45,000	3,429,450.00	0.13
52	122703	PR 鞍城投	50,000	3,222,000.00	0.12
53	124466	13 邕城投	29,990	3,213,128.60	0.12
54	122651	12 广安投	50,130	3,156,184.80	0.12
55	122710	12 济城建	45,000	2,351,250.00	0.09
56	112245	15 顺鑫 01	20,000	2,047,600.00	0.08
57	122670	12 新盛债	30,000	1,566,900.00	0.06
58	122181	12 山鹰债	10,000	1,068,000.00	0.04
59	122560	12 淄城运	10,000	843,400.00	0.03
60	122204	12 双良节	2,000	205,520.00	0.01
61	112221	14 万里债	120	12,426.00	0.00

#### 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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

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 报告期内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中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,069,000.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,855,810.47
5	应收申购款	375,342.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,300,153.84

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	6,154,182.00	0.24

#### 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	600576	万家文化	75,338,043.66	2.92	筹划重大事项
2	000718	苏宁环球	44,600,965.82	1.73	筹划重大事项

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## 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

份额级别	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
上投摩根双息 平衡混合 A	78,073	38,381.02	303,663,298.21	10.13%	2,692,858,197.00	89.87%
上投摩根双息 平衡混合 H	1	94,927.06	94,927.06	100.00%	0.00	0.00%
合计	78,074	38,381.75	303,758,225.27	10.14%	2,692,858,197.00	89.86%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	上投摩根双息平衡混合 A	75,509.16	0.0025%
	上投摩根双息平衡混合 H	-	-
	合计	75,509.16	0.0025%

**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	份额级别	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	上投摩根双息平衡混合 A	0
	上投摩根双息平衡混合 H	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	上投摩根双息平衡混合 A	0
	上投摩根双息平衡混合 H	0
	合计	0

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	上投摩根双息平衡混合 A	上投摩根双息平衡混合 H
基金合同生效日(2006 年 4 月 26 日)基金份额总额	6,435,738,977.50	-
本报告期期初基金份额总额	2,839,459,423.68	-
本报告期基金总申购份额	402,959,744.44	1,097,100.84
减：本报告期基金总赎回份额	245,897,672.91	1,002,173.78
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,996,521,495.21	94,927.06

**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**

基金管理人：

本公司于 2016 年 2 月 3 日发布公告：因届龄退休，陈开元先生自 2016 年 2 月 2 日起不再担任本公司董事长，由穆矢先生继任该职务。

基金托管人：

无。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内无基金投资策略的改变。

**10.5 报告期内改聘会计师事务所情况**

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所的情况。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

## 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	2,191,331,528.54	23.46%	2,040,785.76	23.46%	-
广发证券	1	2,027,437,296.09	21.71%	1,888,148.62	21.71%	-
浙商证券	1	1,218,233,478.19	13.04%	1,134,544.44	13.04%	-
银河证券	2	912,771,519.71	9.77%	850,065.43	9.77%	-
东吴证券	1	730,846,148.81	7.83%	680,636.31	7.83%	-
申银万国	1	680,765,733.66	7.29%	633,994.44	7.29%	-
中信建投	1	580,655,153.69	6.22%	540,758.59	6.22%	-
光大证券	1	438,190,608.12	4.69%	408,087.50	4.69%	-
招商证券	1	256,469,976.38	2.75%	238,849.25	2.75%	-
国信证券	1	251,931,295.66	2.70%	234,623.12	2.70%	-
中金证券	1	50,666,373.16	0.54%	47,183.62	0.54%	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

#### 2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 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基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务。

5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

#### 3. 交易单元的选择程序：

- 1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议, 并通知基金托管人。

4. 2016 年上半年本基金新增东吴证券、中金证券 2 个席位, 无注销席位。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
国泰君安	56,610,376.97	14.98%	-	-	-	-
广发证券	26,346,109.60	6.97%	-	-	-	-
浙商证券	92,767,076.10	24.55%	450,000,000.00	47.37%	-	-
银河证券	3,111,928.55	0.82%	-	-	-	-
东吴证券	8,554,374.17	2.26%	-	-	-	-
申银万国	76,523,271.23	20.25%	90,000,000.00	9.47%	-	-
中信建投	61,813,177.14	16.36%	260,000,000.00	27.37%	-	-
光大证券	8,811,050.21	2.33%	-	-	-	-
招商证券	35,685,072.90	9.44%	80,000,000.00	8.42%	-	-
国信证券	7,665,423.00	2.03%	70,000,000.00	7.37%	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1.	上投摩根基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职情况的公告	基金管理人公司网站、《上海证券报》、《证券时报》和《中国证券报》	2016年1月9日
2.	上投摩根基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	同上	2016年2月3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、中国证监会批准上投摩根双息平衡混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《上投摩根双息平衡混合型证券投资基金基金托管协议》；
- 4、《上投摩根基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照。

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

网址：[www.cifm.com](http://www.cifm.com)

上投摩根基金管理有限公司

二〇一六年八月二十九日

## 13 补充披露

## 补充披露1: 期末基金资产组合情况

名称	数量(股)	公允价值(人民币元)
<b>(1) 股票投资</b>		
上市投资		
中国(100%)		
雏鹰农牧	14,207,269	84,817,395.93
澳洋顺昌	5,942,884	75,890,628.68
万家文化	3,459,047	75,338,043.66
科恒股份	839,884	66,544,009.32
赣锋锂业	1,852,920	61,980,174.00
金信诺	1,589,298	52,653,442.74
太极实业	5,252,177	52,469,248.23
皇氏集团	3,155,676	47,303,583.24
苏宁环球	4,500,602	44,600,965.82
钢研高纳	1,916,623	42,357,368.30
永贵电器	1,207,098	40,956,835.14
亿纬锂能	921,887	39,816,299.53
华业资本	3,859,378	38,670,967.56
当代东方	3,039,189	38,081,038.17
华中数控	1,162,513	35,631,023.45
当升科技	524,348	35,099,855.12
天齐锂业	816,111	34,839,778.59
金龙汽车	2,285,000	33,658,050.00
汉钟精机	2,711,831	33,436,876.23
沧州明珠	1,271,735	32,937,936.50
宁波华翔	1,438,669	32,902,360.03
晶盛机电	2,491,200	32,634,720.00
康得新	1,906,954	32,608,913.40
新纶科技	1,453,306	31,289,678.18
南京熊猫	1,900,651	28,414,732.45
光华科技	1,089,533	27,750,405.51
潮宏基	2,724,860	26,649,130.80
红相电力	1,177,640	25,778,539.60
北信源	1,373,858	25,649,928.86
硕贝德	1,134,051	24,382,096.50
万润股份	467,600	23,791,488.00
华友钴业	634,562	23,605,706.40
骅威文化	897,455	22,077,393.00
三安光电	1,079,445	21,556,516.65

*ST 商城	1,695,712	21,467,713.92
东方时尚	471,635	21,454,676.15
山河智能	2,016,606	20,750,875.74
金鹰股份	1,461,752	19,280,508.88
莱茵体育	1,151,300	19,042,502.00
美亚光电	735,846	16,953,891.84
赤峰黄金	881,400	16,438,110.00
创意信息	418,550	15,846,303.00
高新兴	989,600	15,714,848.00
天通股份	932,020	14,819,118.00
慧球科技	904,337	14,641,216.03
西藏旅游	773,715	14,623,213.50
中体产业	818,624	14,530,576.00
盛达矿业	757,300	13,843,444.00
欣旺达	500,064	12,836,642.88
易成新能	1,606,638	12,467,510.88
山东黄金	316,751	12,324,781.41
威华股份	881,155	11,772,230.80
航新科技	171,332	11,602,603.04
蓝思科技	402,700	11,323,924.00
华兰生物	334,482	10,502,734.80
同有科技	322,140	10,459,885.80
万方发展	441,600	10,448,256.00
大港股份	456,043	10,124,154.60
信息发展	77,185	9,780,883.20
全志科技	86,900	9,296,562.00
通富微电	650,520	9,172,332.00
春兴精工	823,900	9,112,334.00
东方通	113,700	9,036,876.00
格林美	1,024,403	8,984,014.31
上海梅林	771,416	8,832,713.20
绿盟科技	202,888	8,584,191.28
汇中股份	234,224	8,427,379.52
长盈精密	407,351	8,391,430.60
东软载波	314,654	8,338,331.00
银邦股份	1,024,300	8,061,241.00
森源电气	517,191	7,980,257.13
兴森科技	346,500	7,896,735.00
石基信息	299,161	7,891,867.18
易华录	253,200	7,537,764.00
南京公用	735,252	7,359,872.52
普邦园林	954,578	7,025,694.08
通宇通讯	116,432	6,962,633.60
华昌达	398,600	6,812,074.00

坚朗五金	121,285	6,521,494.45
中颖电子	99,499	5,316,231.57
梅泰诺	100,500	5,083,290.00
京运通	661,612	5,074,564.04
恒华科技	102,181	4,674,780.75
中国海诚	265,000	3,937,900.00
永太科技	148,600	3,031,440.00
柳化股份	300,000	2,010,000.00
华灿光电	199,289	1,791,608.11
中国核建	37,059	775,274.28
实达集团	18,800	260,944.00
久之洋	1,473	258,025.41
小康股份	8,662	206,761.94
玲珑轮胎	15,341	199,126.18
三棵树	1,327	154,038.16
上海沪工	1,263	76,664.10
三德科技	1,355	63,508.85
盛讯达	1,306	61,186.10
环球印务	1,080	47,131.20
哈森股份	2,372	34,394.00
洪汇新材	1,629	24,565.32
合诚股份	1,095	20,126.10
新宏泰	1,602	13,600.98
科大国创	926	9,306.30
丰元股份	971	5,631.80
福斯特	51	2,661.69
菲利华	1	26.78
<b>合计</b>		<b>1,904,584,318.59</b>
<b>(2)债券投资</b>		
<b>上市投资</b>		
<b>中国(100%)</b>		
14 国开 02	500,000	53,445,000.00
14 华联 MTN001	300,000	30,600,000.00
16 农发 01	300,000	29,994,000.00
16 国开 09	300,000	29,949,000.00
14 滨高新	199,970	22,026,695.50
12 石油 03	200,000	20,882,000.00
12 衡城投	250,000	20,802,500.00
14 国开 08	200,000	20,392,000.00
15 农发 08	200,000	20,190,000.00

15 粤珠江 CP002	200,000	20,134,000.00
16 国开 04	200,000	19,976,000.00
11 国开 27	200,000	19,440,000.00
12 西城投	210,000	13,395,900.00
12 渝地产	200,000	13,000,000.00
14 青岛莱西债	100,000	10,968,000.00
13 丰城 02	100,000	10,896,000.00
13 丰城 01	100,000	10,817,000.00
13 福东海	100,000	10,593,000.00
13 南山集 MTN002	100,000	10,548,000.00
11 联想债	100,000	10,492,000.00
12 甘公投债	100,000	10,429,000.00
12TCL 集 MTN1	100,000	10,421,000.00
14 兵器 MTN002	100,000	10,307,000.00
12 南山集 MTN3	100,000	10,301,000.00
09 宿建投	100,000	10,147,000.00
13 进出 40	100,000	10,105,000.00
11 海正债	100,000	10,051,000.00
15 农发 16	100,000	10,000,000.00
15 绿地 02	100,000	9,838,000.00
13 牡丹 01	94,500	9,742,950.00
12 大丰债	100,000	8,549,000.00
09 兖城投	85,000	8,530,600.00
14 凤凰债	80,000	8,340,000.00
12 慈国控	100,000	8,286,000.00
12 筑住投	100,000	8,281,000.00
10 南昌债	80,000	8,216,800.00
12 万向债	80,000	8,190,400.00
13 武地产债	100,000	7,822,000.00
12 淮建投	100,000	7,709,000.00
12 华发集	130,000	6,884,800.00
13 乳国资	65,000	6,861,400.00
14 银城投	60,000	6,358,800.00
航信转债	55,800	6,154,182.00
12 渝江北	70,000	5,813,500.00
13 冶城投	50,000	5,368,500.00
12 来宾债	50,120	5,355,823.20
12 光电债	50,000	5,085,500.00
12 旅建债	55,000	4,559,500.00
12 柳东债	60,000	3,821,400.00
13 新沂债	35,000	3,617,600.00
12 赣城债	45,000	3,429,450.00
PR 鞍城投	50,000	3,222,000.00
13 邕城投	29,990	3,213,128.60

12 广安投	50,130	3,156,184.80
12 济城建	45,000	2,351,250.00
15 顺鑫 01	20,000	2,047,600.00
12 新盛债	30,000	1,566,900.00
12 山鹰债	10,000	1,068,000.00
12 淄城运	10,000	843,400.00
12 双良节	2,000	205,520.00
14 万里债	120	12,426.00
<b>合计</b>		<b>654,804,710.10</b>
<b>总投资资产</b>		<b>2,559,389,028.69</b>
<b>银行存款和结算备付金</b>		<b>69,985,538.21</b>
<b>其他各项资产</b>		<b>16,300,153.84</b>
<b>合计</b>		<b>2,645,674,720.74</b>

## 补充披露 2: 投资组合变动表

序号	证券类别	占基金资产净值的比例 (%)	占基金资产净值的比例 (%)
		2016 年 6 月 30 日	2015 年 12 月 31 日
1	股票	73.81	70.64
2	债券	25.38	26.82