

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

2017年半年度报告

2017年6月30日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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2017年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
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遵规守信情况的说明.....	9
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.....	10
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	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	15
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告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
7.3.1 期末指数投资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
7.3.2 期末积极投资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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	48

8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4 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.....	50
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
11 影响投资者决策的其他重要信息	54
12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
基金简称	国联安双力中小板(LOF)
场内简称	国安双力
基金主代码	162510
交易代码	162510
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年3月24日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
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	17,512,205.20份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年5月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

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		国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陆康芸	田青
	联系电话	021-38992806	010-67595096
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9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 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200121	100033
法定代表人	虞启斌	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报及深交所网站
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com
基金半年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318号9楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街27号投资广场23层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	2,000,455.33
本期利润	41,063.44
加权平均基金份额本期利润	0.0019
本期加权平均净值利润率	0.18%
本期基金份额净值增长率	-1.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,619,621.08
期末可供分配基金份额利润	0.0925
期末基金资产净值	18,131,621.17
期末基金份额净值	1.035
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.48%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字；

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

3、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.44%	0.74%	5.23%	0.83%	-0.79%	-0.09%
过去三个月	-2.73%	0.76%	-3.38%	0.86%	0.65%	-0.10%
过去六个月	-1.71%	0.73%	-2.29%	0.83%	0.58%	-0.10%
过去一年	-0.29%	0.83%	-2.98%	0.86%	2.69%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金份额转换日次日起至今	1.48%	2.09%	4.63%	2.05%	-3.15%	0.04%

注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

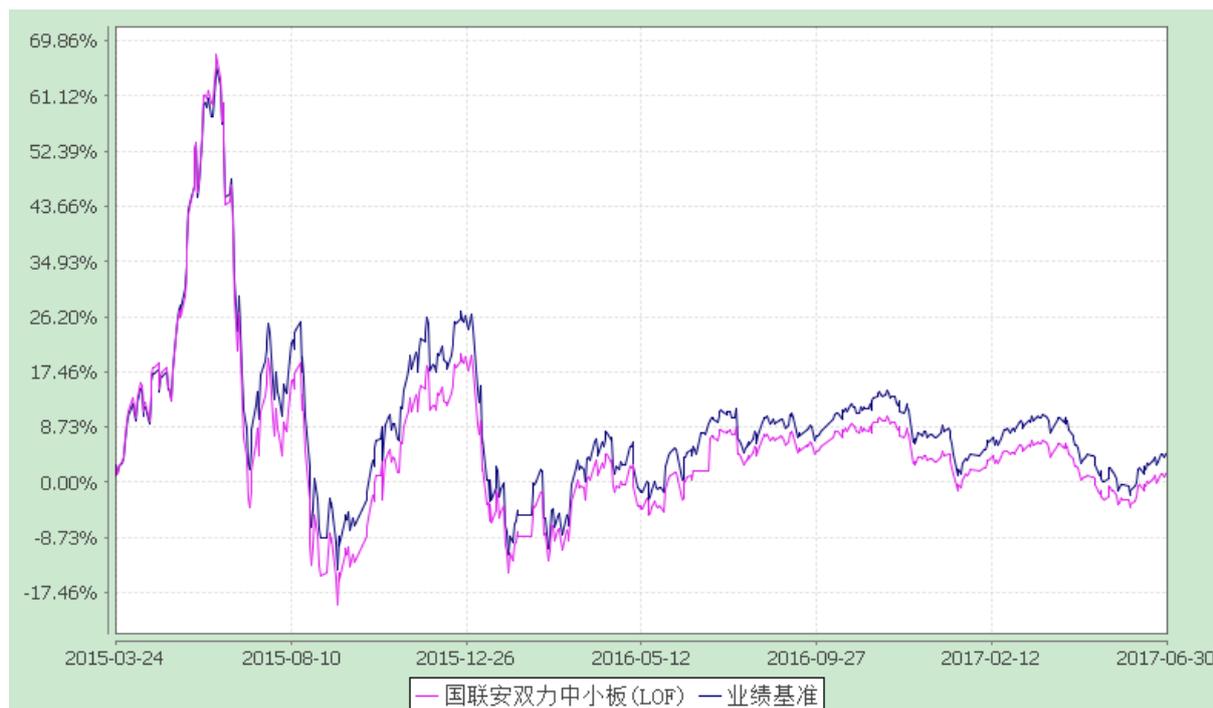
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2 自基金转型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

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年3月24日至2017年6月30日)



注：1、本基金份额转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于2012年3月23日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

4、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理四十二只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和

风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

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		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理	2016-08-19	-	15年（自2002年起）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士。2003年10月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理，2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2016年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理。

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统内的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下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未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年，股市表现出较大的分化，大盘蓝筹股持续上涨，而前几年表现抢眼的中小盘股则遭遇滑铁卢，经历了较大幅度的下跌。从整个上半年来看，沪深 300 指数上涨 10.78%，而中小板综指下跌 2.44%。分板块来看，安防、家电等板块表现较好，传媒、电子、医药等行业表现较差。依据基金合同的约定，双力基金始终保持合理的仓位，采用抽样复制的方法跟踪中小板综指，将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.035 元，本报告期份额净值增长率为-1.71%，同期业绩比较基准收益率为-2.29%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.10%，年化跟踪误差为 2.27%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，以及年化跟踪误差不超过 4.0% 的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，金融去杠杆将会持续进行下去，放眼全球，局部军事冲突、难民涌入欧洲以及特朗普

任期内美国政府政策等问题给全球的经济复苏带来很大的不确定性，下半年宏观经济面依旧不容乐观。预计监管部门将持续控制金融风险，保持货币政策中性偏紧。在这样的背景下，估值合理、盈利稳定增长的股票，应该是较好的投资选择。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

基金管理人拟加大营销力度，提升基金规模。

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：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,104,132.94	4,064,273.96
结算备付金		-	-
存出保证金		8,319.24	2,418.85
交易性金融资产	6.4.7.2	16,119,670.57	27,131,623.87
其中：股票投资		16,119,670.57	27,131,623.87
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	430.92	920.23
应收股利		-	-
应收申购款		496.91	1,994,631.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		18,233,050.58	33,193,867.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
负债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	-	-
应付证券清算款		-	1,432,740.59
应付赎回款		2,691.67	44,907.59
应付管理人报酬		10,925.05	14,132.34
应付托管费		3,204.68	4,145.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		87.78	10,289.77
应交税费	6.4.7.7	-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,520.23	96,226.87
负债合计		101,429.41	1,602,442.63
所有者权益：		-	-
实收基金		16,512,000.09	28,275,106.83
未分配利润	6.4.7.9	1,619,621.08	3,316,318.53
所有者权益合计	6.4.7.10	18,131,621.17	31,591,425.36
负债和所有者权益总计		18,233,050.58	33,193,867.99

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.035 元，基金份额总额 17,512,205.20 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		392,666.46	-1,657,379.44
1.利息收入		10,481.73	352,135.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,481.73	352,135.72
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,313,050.10	432,029.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,214,652.84	304,470.13
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		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	98,397.26	127,559.60
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,959,391.89	-2,809,157.45
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	28,526.52	367,612.56
减：二、费用		351,603.02	720,364.85
1. 管理人报酬		87,073.86	401,833.97
2. 托管费		25,541.67	117,871.26
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	54,470.56	43,902.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	184,516.93	156,757.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,063.44	-2,377,744.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,063.44	-2,377,744.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	28,275,106.83	3,316,318.53	31,591,425.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,063.44	41,063.44
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）	-11,763,106.74	-1,737,760.89	-13,500,867.63
其中：1.基金申购款	8,766,274.50	927,446.05	9,693,720.55
2.基金赎回款	-20,529,381.24	-2,665,206.94	-23,194,588.18
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	16,512,000.09	1,619,621.08	18,131,621.17

项目	上年度可比期间		
	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）	11,245,301.70	13,295,886.22	24,541,187.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,377,744.29	-2,377,744.29
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）	1,249,487,700.11	1,295,724,910.05	2,545,212,610.16
其中：1.基金申购款	1,513,071,691.09	1,326,331,685.22	2,839,403,376.31
2.基金赎回款	-263,583,990.98	-30,606,775.17	-294,190,766.15
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）	-	-1,169,108,879.21	-1,169,108,879.21
五、期末所有者权益（基金净值）	1,260,733,001.81	137,534,172.77	1,398,267,174.58

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：谭晓雨，主管会计工作负责人：李柯，会计机构负责人：仲晓峰

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由原国联安双力中小板综指分级证券投资基金转型而来。根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》原国联安双力中小板综指分级证券投资基金为契约型基金，封闭期为 3 年期。国联安双力中小板综指分级证券投资基金在深圳证券交易所交易上市，至 2015 年 3 月 23 日终止上市。自 2015 年 3 月 24 日（转型后首日）起，国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满后自动转为上市开放式基金（LOF），并更名为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》，国联安双力中小板综指分级证券投资基金在封闭期届满后，按照基金合同在封闭期内的资产及收益的分配约定分别对双力 A 份额和双力 B 份额计算封闭期末基金份额净值，

并以各自的份额净值为基础，按照国联安双力中小板综指分级证券投资基金的基金份额净值转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的份额。于2015年3月23日(基金份额转换日)日终，双力A份额转换前份额数为6,744,926.00份，转换比例为0.61668539，转换后对应本基金份额数为4,159,497.00份；双力B份额转换前份额数为6,744,927.00份，转换比例为1.38331461，转换后对应本基金份额数为9,330,356.00份。本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司根据基金合同约定，对双力A、双力B的份额持有人的基金份额进行了计算，并向中国证券登记结算有限责任公司提交份额变更登记申请。

经深圳证券交易所审核同意，本基金于2015年5月20日在深圳证券交易所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股（包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况、自2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 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（以下简称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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、债券收入免征增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品（含公开募集证券投资基金）过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为（以下称其他业务），继续按照现行规定缴纳增值税。管

理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额，未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2017 年 6 月 30 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 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。

(g) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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 2017年6月30日
活期存款	2,104,132.94
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,104,132.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,318,777.90	16,119,670.57	800,892.67
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		15,318,777.90	16,119,670.57	800,892.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有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 2017年6月30日
应收活期存款利息	427.22
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	-
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	3.70
合计	430.92

注：此处其他列示的是基金上交所和深交所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	87.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	87.78

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.87
审计费	32,232.48
预提费用	21,638.75
指数使用费	887.35
上市费	29,752.78
合计	84,520.23

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,993,045.51	28,275,106.83
本期申购	9,297,270.16	8,766,274.50
本期赎回（以“-”号填列）	-21,778,110.47	-20,529,381.24
本期末	17,512,205.20	16,512,000.09

注：此处申购含转换入份额，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	9,158,998.40	-5,842,679.87	3,316,318.53
本期利润	2,000,455.33	-1,959,391.89	41,063.44
本期基金份额交易产生的变动数	-4,047,003.93	2,309,243.04	-1,737,760.89
其中：基金申购款	2,979,017.45	-2,051,571.40	927,446.05
基金赎回款	-7,026,021.38	4,360,814.44	-2,665,206.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,112,449.80	-5,492,828.72	1,619,621.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	10,168.76
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	256.37
其他	56.60
合计	10,481.73

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	21,914,331.64
减：卖出股票成本总额	19,699,678.80
买卖股票差价收入	2,214,652.84

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	98,397.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	98,397.26

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	-1,959,391.89

——股票投资	-1,959,391.89
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-1,959,391.89

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	28,526.52
合计	28,526.52

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	54,470.56
银行间市场交易费用	0.00
合计	54,470.56

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	21,638.75
银行划款费用	1,063.20
上市费	29,752.78
指数使用费	99,829.72
合计	184,516.93

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

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司（“中德安联”）	基金管理人的股东控制的公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

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

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	87,073.86	401,833.97
其中：支付销售机构的客户维护费	35,091.39	46,145.59

注：1、在本基金分级运作期内，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.0%/当年天数；

2、在本基金分级运作期到期后，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,541.67	117,871.26

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(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

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国建设银行股份有限公司	2,104,132.94	10,168.76	1,665,220,084.70	238,217.54

注：本基金通过建设银行基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2017年6月30日的相关余额为人民币0元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2017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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

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
002696	百洋股份	2017-06-22	重大事项	20.87	2017-07-03	21.74	1,561.00	25,978.73	32,578.07	-
002006	精功科技	2017-05-22	重大事项	7.91	-	-	1,498.00	19,475.73	11,849.18	-
002010	传化智联	2017-06-30	重大事项	15.26	2017-07-04	16.77	1,144.00	18,827.94	17,457.44	-
002012	凯恩股份	2017-04-20	重大事项	11.77	-	-	10,088.00	125,417.55	118,735.76	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	5,169.00	53,573.40	53,395.77	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04	22.46	1,388.00	14,141.88	34,630.60	-
002044	紫光国	2017-02	重大事项	30.82	2017-0	27.74	10,100.00	380,590.96	311,282.00	-

9	芯	-20	项		7-17						
002070	*ST众和	2017-05-02	重大事项	10.17	-	-	1,200.00	17,076.00	12,204.00	-	
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大事项	16.12	-	-	7,280.00	176,280.00	117,353.60	-	
002122	天马股份	2017-04-24	重大事项	10.30	2017-07-24	11.15	3,199.00	30,494.26	32,949.70	-	
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-07-06	12.61	2,800.00	24,778.71	33,824.00	-	
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项	8.70	2017-08-14	9.57	4,253.00	43,813.52	37,001.10	-	
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	7,948.00	105,695.21	65,729.96	-	
002141	贤丰控股	2017-05-02	重大事项	7.15	-	-	1,946.00	11,726.78	13,913.90	-	
002143	印纪传媒	2017-04-18	重大事项	24.93	-	-	1,100.00	31,430.38	27,423.00	-	
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大事项	16.99	-	-	5,409.00	67,966.02	91,898.91	-	
002175	东方网络	2017-03-09	重大事项	16.38	2017-07-13	14.74	1,620.00	26,314.26	26,535.60	-	
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	11,400.00	243,905.09	230,736.00	-	
002255	海陆重工	2017-03-06	重大事项	10.06	2017-07-21	9.05	1,822.00	14,065.34	18,329.32	-	
002256	兆新股份	2017-06-05	重大事项	4.39	-	-	3,848.00	15,355.14	16,892.72	-	
002312	*ST三泰	2017-03-31	重大事项	6.82	2017-07-24	7.16	11,850.00	106,628.04	80,817.00	-	
002331	皖通科技	2017-05-02	重大事项	14.16	-	-	1,388.00	23,296.74	19,654.08	-	
002348	高乐股份	2017-05-11	重大事项	7.01	2017-07-27	6.70	2,300.00	21,699.92	16,123.00	-	
002356	赫美集团	2017-06-14	重大事项	25.41	-	-	602.00	9,753.55	15,296.82	-	
002358	森源电气	2017-05-12	重大事项	17.02	2017-07-12	16.68	1,764.00	35,902.37	30,023.28	-	
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23	-	-	3,341.00	61,199.84	67,588.43	-	
002417	三元达	2017-03-15	重大事项	15.50	2017-08-01	13.95	686.00	5,618.92	10,633.00	-	
002418	康盛股份	2017-03-20	重大事项	9.31	2017-07-10	9.30	1,751.00	11,498.55	16,301.81	-	
002422	胜利精	2017-01	重大事	7.68	-	-	8,200.00	65,334.00	62,976.00	-	

6	密	-16	项							
002427	尤夫股份	2017-05-22	重大事项	25.11	2017-07-21	23.00	1,200.00	31,856.80	30,132.00	-
002504	*ST弘高	2017-05-02	重大事项	8.10	-	-	1,273.00	6,982.67	10,311.30	-
002567	唐人神	2017-06-05	重大事项	9.70	2017-08-14	9.54	2,215.00	13,362.50	21,485.50	-
002596	海南瑞泽	2017-05-22	重大事项	8.29	-	-	1,932.00	11,666.70	16,016.28	-
002600	江粉磁材	2017-02-27	重大事项	11.46	2017-08-09	6.25	2,954.00	24,211.94	33,852.84	-
002622	融钰集团	2017-04-20	重大事项	12.30	-	-	2,154.00	16,225.49	26,494.20	-
002625	光启技术	2017-04-13	重大事项	36.36	-	-	600.00	20,778.00	21,816.00	-
002638	勤上股份	2017-04-26	重大事项	8.14	-	-	6,897.00	51,970.86	56,141.58	-
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	4,780.00	104,402.34	119,786.80	-
002650	加加食品	2017-04-20	重大事项	5.88	-	-	3,141.00	20,649.03	18,469.08	-
002654	万润科技	2017-05-10	重大事项	9.28	-	-	1,400.00	15,993.11	12,992.00	-
002675	东诚药业	2017-01-03	重大事项	14.26	2017-07-17	12.84	3,101.00	26,336.33	44,220.26	-
002676	顺威股份	2017-06-30	重大事项	15.98	-	-	2,398.00	23,322.42	38,320.04	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	2,124.00	32,722.67	26,741.16	-
002693	双成药业	2017-05-25	重大事项	6.67	2017-07-25	6.88	1,200.00	11,675.52	8,004.00	-
002694	顾地科技	2017-05-25	重大事项	21.81	-	-	1,760.00	25,141.44	38,385.60	-

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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，因此

没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期信用债券投资。

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与可能遭受的损失。本基金的流动性风险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，另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。本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易，因此除在附注 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30 日	1个月以 内	1-3 个月	6个月以 内	3个月 -1年	6个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产										
银行存款	2,104,13 2.94	-	-	-	-	-	-	-	-	2,104,13 2.94
结算备付金	0.00	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
存出保证金	8,319.24	-	-	-	-	-	-	-	-	8,319.24

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	16,119,670.57	16,119,670.57
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	430.92	430.92
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	496.91	496.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	2,112,452.18	-	-	0.00	-	-	0.00	0.00	-	16,120,598.40	18,233,050.58
负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,691.67	2,691.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	-	10,925.05	10,925.05
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,204.68	3,204.68
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	87.78	87.78
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	84,520.23	84,520.23
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	101,429.41	101,429.41
利率敏感度缺口	2,112,452.18	-	-	-	-	-	-	-	-	16,019,168.99	18,131,621.17
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计	
资产											
银行存款	4,064,273.96	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,064,273.96
结算备付金	0.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
存出保证金	2,418.85	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,418.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	27,131,623.87	27,131,623.87
买入返售金融	0.00	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00

资产										
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	920.23	920.23
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	118.86	-	-	-	-	-	-	-	1,994,512.22	1,994,631.08
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	4,066,811.67	0.00	-	0.00	-	-	0.00	0.00	29,127,056.32	33,193,867.99
负债										
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	1,432,740.59	1,432,740.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	44,907.59	44,907.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	14,132.34	14,132.34
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	4,145.47	4,145.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	10,289.77	10,289.77
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	96,226.87	96,226.87
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	1,602,442.63	1,602,442.63
利率敏感度缺口	4,066,811.67	0.00	-	0.00	-	-	0.00	0.00	27,524,613.69	31,591,425.36

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

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的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 88.90%，无债券投资和衍生金融资产。于 2017 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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 2017年6月30日		上年度末 2016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	16,119,670.57	88.90	27,131,623.87	85.88
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	-	-	-	-
合计	16,119,670.57	88.90	27,131,623.87	85.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2017年6月30日	2016年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加786,076.50	增加1,472,998.61
	业绩比较基准下降5%	减少786,076.50	减少1,472,998.61

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	16,119,670.57	88.41
	其中：股票	16,119,670.57	88.41
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	2,104,132.94	11.54
7	其他各项资产	9,247.07	0.05
8	合计	18,233,050.58	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	217,263.12	1.20
B	采矿业		

		81,760.31	0.45
C	制造业	12,389,134.43	68.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,698.82	0.36
E	建筑业	504,453.16	2.78
F	批发和零售业	485,337.50	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	105,075.67	0.58
H	住宿和餐饮业	35,680.50	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,023,976.72	5.65
J	金融业	394,838.88	2.18
K	房地产业	282,219.27	1.56
L	租赁和商务服务业	279,978.33	1.54
M	科学研究和技术服务业	32,109.62	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	45,168.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	176,976.24	0.98
S	综合	0.00	0.00
	合计	16,119,670.57	88.90

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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

7.3.1 期末指数投资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	002415	海康威视	20,067	648,164.10	3.57
2	002049	紫光国芯	10,100	311,282.00	1.72
3	002304	洋河股份	3,462	300,536.22	1.66
4	002252	上海莱士	11,400	230,736.00	1.27
5	002465	海格通信	18,174	195,188.76	1.08
6	002142	宁波银行	9,496	183,272.80	1.01
7	002450	康得新	7,919	178,335.88	0.98
8	002024	苏宁云商	13,800	155,250.00	0.86
9	002475	立讯精密	5,213	152,428.12	0.84
10	002370	亚太药业	4,900	143,668.00	0.79
11	002241	歌尔股份	7,072	136,348.16	0.75
12	002223	鱼跃医疗	5,550	131,424.00	0.72
13	002456	欧菲光	7,020	127,553.40	0.70
14	002739	万达电影	2,500	127,425.00	0.70
15	002466	天齐锂业	2,300	125,005.00	0.69
16	002511	中顺洁柔	9,226	122,059.98	0.67
17	002642	荣之联	4,780	119,786.80	0.66
18	002012	凯恩股份	10,088	118,735.76	0.65
19	002075	沙钢股份	7,280	117,353.60	0.65
20	002011	盾安环境	10,144	115,134.40	0.63
21	002594	比亚迪	2,254	112,587.30	0.62
22	002085	万丰奥威	5,772	112,265.40	0.62
23	002183	怡亚通	12,900	111,327.00	0.61
24	002508	老板电器	2,535	110,221.80	0.61
25	002236	大华股份	4,772	108,849.32	0.60
26	002230	科大讯飞	2,600	103,740.00	0.57
27	002146	荣盛发展	10,383	102,480.21	0.57
28	002506	协鑫集成	21,500	98,685.00	0.54
29	002008	大族激光	2,718	94,151.52	0.52
30	002168	深圳惠程	5,409	91,898.91	0.51
31	002493	荣盛石化	9,273	90,504.48	0.50
32	002292	奥飞娱乐	5,312	89,772.80	0.50
33	002202	金风科技	5,621	86,956.87	0.48
34	002007	华兰生物	2,349	85,738.50	0.47
35	002104	恒宝股份	8,959	84,125.01	0.46
36	002312	*ST 三泰	11,850	80,817.00	0.45
37	002065	东华软件	3,700	80,623.00	0.44
38	002299	圣农发展	5,370	79,851.90	0.44
39	002751	易尚展示	2,100	77,805.00	0.43
40	002698	博实股份	6,500	76,505.00	0.42
41	002612	朗姿股份	5,642	76,392.68	0.42
42	002311	海大集团	4,181	76,386.87	0.42

43	002081	金螳螂	6,876	75,498.48	0.42
44	002276	万马股份	7,381	74,474.29	0.41
45	002500	山西证券	7,650	73,287.00	0.40
46	002050	三花智控	4,474	73,015.68	0.40
47	002161	远望谷	9,000	72,900.00	0.40
48	002179	中航光电	2,198	68,555.62	0.38
49	002310	东方园林	4,060	67,883.20	0.37
50	002399	海普瑞	3,341	67,588.43	0.37
51	002673	西部证券	4,744	67,459.68	0.37
52	002184	海得控制	4,794	67,116.00	0.37
53	002129	中环股份	7,948	65,729.96	0.36
54	002572	索菲亚	1,600	65,600.00	0.36
55	002736	国信证券	4,900	64,925.00	0.36
56	002051	中工国际	3,110	64,470.30	0.36
57	002426	胜利精密	8,200	62,976.00	0.35
58	002302	西部建设	2,832	62,785.44	0.35
59	002271	东方雨虹	1,598	59,285.80	0.33
60	002470	金正大	7,548	56,836.44	0.31
61	002032	苏泊尔	1,372	56,320.60	0.31
62	002638	勤上股份	6,897	56,141.58	0.31
63	002460	赣锋锂业	1,200	55,500.00	0.31
64	002013	中航机电	5,169	53,395.77	0.29
65	002035	华帝股份	2,206	53,385.20	0.29
66	002001	新和成	2,709	52,581.69	0.29
67	002602	世纪华通	1,422	51,561.72	0.28
68	002340	格林美	8,320	50,336.00	0.28
69	002405	四维图新	2,537	50,131.12	0.28
70	002408	齐翔腾达	4,516	50,037.28	0.28
71	002294	信立泰	1,398	49,852.68	0.27
72	002078	太阳纸业	6,781	49,840.35	0.27
73	002657	中科金财	1,700	49,283.00	0.27
74	002287	奇正藏药	1,151	47,317.61	0.26
75	002359	齐星铁塔	1,200	47,100.00	0.26
76	002685	华东重机	5,128	46,972.48	0.26
77	002372	伟星新材	2,480	46,326.40	0.26
78	002573	清新环境	2,400	45,168.00	0.25
79	002018	华信国际	6,572	45,018.20	0.25
80	002152	广电运通	5,397	44,849.07	0.25
81	002640	跨境通	2,100	44,625.00	0.25
82	002492	恒基达鑫	4,752	44,336.16	0.24
83	002333	罗普斯金	2,984	44,222.88	0.24
84	002675	东诚药业	3,101	44,220.26	0.24
85	002444	巨星科技	2,806	43,717.48	0.24
86	002422	科伦药业	2,646	43,711.92	0.24

87	002410	广联达	2,300	43,240.00	0.24
88	002563	森马服饰	5,086	43,129.28	0.24
89	002603	以岭药业	2,465	43,038.90	0.24
90	002244	滨江集团	6,156	42,599.52	0.23
91	002115	三维通信	4,119	42,508.08	0.23
92	002108	沧州明珠	3,181	42,466.35	0.23
93	002038	双鹭药业	1,456	42,442.40	0.23
94	002385	大北农	6,716	42,243.64	0.23
95	002437	誉衡药业	5,800	42,224.00	0.23
96	002647	民盛金科	1,074	41,886.00	0.23
97	002242	九阳股份	2,100	41,307.00	0.23
98	002384	东山精密	1,633	40,335.10	0.22
99	002281	光迅科技	1,800	39,996.00	0.22
100	002491	通鼎互联	2,948	39,621.12	0.22
101	002285	世联行	4,811	38,584.22	0.21
102	002694	顾地科技	1,760	38,385.60	0.21
103	002676	顺威股份	2,398	38,320.04	0.21
104	002092	中泰化学	3,013	38,265.10	0.21
105	002074	国轩高科	1,207	38,080.85	0.21
106	002570	贝因美	2,800	38,080.00	0.21
107	002424	贵州百灵	2,000	37,720.00	0.21
108	002597	金禾实业	1,722	37,642.92	0.21
109	002030	达安基因	1,707	37,195.53	0.21
110	002128	露天煤业	4,253	37,001.10	0.20
111	002082	栋梁新材	2,200	35,838.00	0.20
112	002389	南洋科技	1,700	35,802.00	0.20
113	002186	全聚德	1,762	35,680.50	0.20
114	002595	豪迈科技	1,600	35,568.00	0.20
115	002714	牧原股份	1,300	35,386.00	0.20
116	002221	东华能源	3,236	35,304.76	0.19
117	002219	恒康医疗	2,912	35,060.48	0.19
118	002434	万里扬	2,200	35,024.00	0.19
119	002195	二三四五	4,896	35,006.40	0.19
120	002443	金洲管道	3,800	34,960.00	0.19
121	002210	飞马国际	2,030	34,855.10	0.19
122	002544	杰赛科技	1,526	34,792.80	0.19
123	002025	航天电器	1,388	34,630.60	0.19
124	002138	顺络电子	1,850	34,373.00	0.19
125	002601	龙蟠佰利	2,083	34,119.54	0.19
126	002407	多氟多	1,550	34,084.50	0.19
127	002600	江粉磁材	2,954	33,852.84	0.19
128	002127	南极电商	2,800	33,824.00	0.19
129	002498	汉缆股份	9,140	33,452.40	0.18
130	002273	水晶光电	1,612	33,255.56	0.18

131	002280	联络互动	3,055	33,238.40	0.18
132	002262	恩华药业	2,193	33,180.09	0.18
133	002185	华天科技	4,570	33,086.80	0.18
134	002429	兆驰股份	10,755	33,017.85	0.18
135	002122	天马股份	3,199	32,949.70	0.18
136	002489	浙江永强	5,151	32,863.38	0.18
137	002047	宝鹰股份	3,792	32,762.88	0.18
138	002589	瑞康医药	2,125	32,725.00	0.18
139	002510	天汽模	4,500	32,670.00	0.18
140	002191	劲嘉股份	3,484	32,610.24	0.18
141	002696	百洋股份	1,561	32,578.07	0.18
142	002503	搜于特	4,626	32,520.78	0.18
143	002482	广田集团	3,615	32,498.85	0.18
144	002056	横店东磁	4,332	32,490.00	0.18
145	002695	煌上煌	1,512	32,296.32	0.18
146	002004	华邦健康	4,123	32,283.09	0.18
147	002203	海亮股份	3,949	32,144.86	0.18
148	002153	石基信息	1,395	31,708.35	0.17
149	002316	键桥通讯	2,276	31,522.60	0.17
150	002678	珠江钢琴	2,482	31,471.76	0.17
151	002665	首航节能	4,308	31,017.60	0.17
152	002624	完美世界	900	30,870.00	0.17
153	002187	广百股份	2,455	30,613.85	0.17
154	002041	登海种业	2,305	30,541.25	0.17
155	002400	省广股份	3,800	30,514.00	0.17
156	002701	奥瑞金	4,741	30,294.99	0.17
157	002427	尤夫股份	1,200	30,132.00	0.17
158	002358	森源电气	1,764	30,023.28	0.17
159	002353	杰瑞股份	1,885	29,820.70	0.16
160	002643	万润股份	2,000	29,520.00	0.16
161	002308	威创股份	2,256	29,440.80	0.16
162	002419	天虹股份	2,025	29,119.50	0.16
163	002307	北新路桥	1,600	28,880.00	0.16
164	002431	棕榈股份	2,607	28,729.14	0.16
165	002335	科华恒盛	808	28,635.52	0.16
166	002174	游族网络	900	28,584.00	0.16
167	002375	亚厦股份	3,153	28,093.23	0.15
168	002416	爱施德	2,600	28,054.00	0.15
169	002261	拓维信息	2,390	27,986.90	0.15
170	002366	台海核电	596	27,958.36	0.15
171	002439	启明星辰	1,484	27,602.40	0.15
172	002250	联化科技	1,927	27,556.10	0.15
173	002531	天顺风能	4,131	27,471.15	0.15
174	002461	珠江啤酒	2,248	27,448.08	0.15

175	002143	印纪传媒	1,100	27,423.00	0.15
176	002269	美邦服饰	7,339	27,374.47	0.15
177	002396	星网锐捷	1,413	27,341.55	0.15
178	002155	湖南黄金	2,853	27,303.21	0.15
179	002635	安洁科技	750	27,165.00	0.15
180	002268	卫士通	1,600	26,912.00	0.15
181	002681	奋达科技	2,124	26,741.16	0.15
182	002019	亿帆医药	1,600	26,688.00	0.15
183	002175	东方网络	1,620	26,535.60	0.15
184	002343	慈文传媒	700	26,502.00	0.15
185	002622	融钰集团	2,154	26,494.20	0.15
186	002131	利欧股份	8,050	26,484.50	0.15
187	002267	陕天然气	3,008	26,440.32	0.15
188	002485	希努尔	1,025	26,414.25	0.15
189	002048	宁波华翔	1,259	26,262.74	0.14
190	002662	京威股份	3,630	26,136.00	0.14
191	002376	新北洋	1,892	25,958.24	0.14
192	002190	成飞集成	961	25,754.80	0.14
193	002217	合力泰	2,600	25,688.00	0.14
194	002275	桂林三金	1,449	25,661.79	0.14
195	002237	恒邦股份	2,435	25,543.15	0.14
196	002156	通富微电	2,508	25,531.44	0.14
197	002537	海联金汇	2,094	25,504.92	0.14
198	002301	齐心集团	1,222	25,332.06	0.14
199	002617	露笑科技	1,681	25,265.43	0.14
200	002080	中材科技	1,274	25,250.68	0.14
201	002451	摩恩电气	1,215	25,101.90	0.14
202	002344	海宁皮城	2,993	24,901.76	0.14
203	002233	塔牌集团	2,032	24,729.44	0.14
204	002042	华孚色纺	2,290	24,480.10	0.14
205	002462	嘉事堂	623	24,477.67	0.13
206	002345	潮宏基	2,234	24,283.58	0.13
207	002646	青青稞酒	1,387	24,217.02	0.13
208	002117	东港股份	931	24,094.28	0.13
209	002028	思源电气	1,506	24,005.64	0.13
210	002414	高德红外	1,300	23,790.00	0.13
211	002543	万和电气	968	23,783.76	0.13
212	002557	洽洽食品	1,636	23,672.92	0.13
213	002251	步步高	1,905	23,602.95	0.13
214	002501	利源精制	2,074	23,581.38	0.13
215	002134	*ST 普林	2,600	23,530.00	0.13
216	002477	雏鹰农牧	5,300	23,479.00	0.13
217	002254	泰和新材	1,756	23,354.80	0.13
218	002626	金达威	1,636	23,313.00	0.13

219	002479	富春环保	1,955	23,264.50	0.13
220	002053	云南能投	1,846	23,167.30	0.13
221	002303	美盈森	2,952	22,789.44	0.13
222	002440	闰土股份	1,493	22,783.18	0.13
223	002204	大连重工	5,594	22,767.58	0.13
224	002055	得润电子	1,000	22,730.00	0.13
225	002176	江特电机	2,600	22,672.00	0.13
226	002518	科士达	1,531	22,383.22	0.12
227	002378	章源钨业	2,458	22,244.90	0.12
228	002668	奥马电器	1,120	22,064.00	0.12
229	002463	沪电股份	4,848	22,058.40	0.12
230	002481	双塔食品	3,300	22,011.00	0.12
231	002277	友阿股份	3,386	21,839.70	0.12
232	002625	光启技术	600	21,816.00	0.12
233	002147	新光圆成	1,399	21,740.46	0.12
234	002567	唐人神	2,215	21,485.50	0.12
235	002293	罗莱生活	1,865	21,372.90	0.12
236	002284	亚太股份	1,917	21,278.70	0.12
237	002064	华峰氨纶	4,410	21,256.20	0.12
238	002618	丹邦科技	1,773	21,222.81	0.12
239	002089	新海宜	3,122	21,135.94	0.12
240	002413	雷科防务	1,880	21,056.00	0.12
241	002206	海利得	2,805	20,841.15	0.11
242	002578	闽发铝业	4,794	20,805.96	0.11
243	002630	华西能源	1,794	20,792.46	0.11
244	002445	中南文化	1,614	20,739.90	0.11
245	002093	国脉科技	2,353	20,706.40	0.11
246	002110	三钢闽光	1,600	20,512.00	0.11
247	002689	远大智能	3,105	20,493.00	0.11
248	002083	孚日股份	2,682	20,490.48	0.11
249	002534	杭锅股份	2,166	20,490.36	0.11
250	002468	申通快递	800	20,328.00	0.11
251	002433	太安堂	2,187	20,229.75	0.11
252	002430	杭氧股份	2,284	20,076.36	0.11
253	002436	兴森科技	3,164	19,933.20	0.11
254	002266	浙富控股	4,069	19,856.72	0.11
255	002283	天润曲轴	3,090	19,776.00	0.11
256	002249	大洋电机	3,000	19,740.00	0.11
257	002449	国星光电	1,191	19,711.05	0.11
258	002178	延华智能	1,800	19,674.00	0.11
259	002331	皖通科技	1,388	19,654.08	0.11
260	002421	达实智能	3,200	19,584.00	0.11
261	002305	南国置业	3,612	19,540.92	0.11
262	002118	紫鑫药业	2,854	19,492.82	0.11

263	002382	蓝帆医疗	1,572	19,225.56	0.11
264	002393	力生制药	531	19,046.97	0.11
265	002029	七匹狼	1,986	19,006.02	0.10
266	002614	奥佳华	1,039	18,889.02	0.10
267	002106	莱宝高科	1,858	18,821.54	0.10
268	002022	科华生物	1,082	18,794.34	0.10
269	002402	和而泰	1,900	18,734.00	0.10
270	002484	江海股份	1,878	18,629.76	0.10
271	002020	京新药业	1,564	18,533.40	0.10
272	002428	云南锗业	1,734	18,519.12	0.10
273	002650	加加食品	3,141	18,469.08	0.10
274	002045	国光电器	1,162	18,464.18	0.10
275	002663	普邦股份	3,400	18,462.00	0.10
276	002313	日海通讯	900	18,459.00	0.10
277	002031	巨轮智能	5,934	18,454.74	0.10
278	002332	仙琚制药	2,142	18,421.20	0.10
279	002091	江苏国泰	1,928	18,412.40	0.10
280	002577	雷柏科技	800	18,376.00	0.10
281	002255	海陆重工	1,822	18,329.32	0.10
282	002435	长江润发	1,069	18,322.66	0.10
283	002036	联创电子	1,100	18,150.00	0.10
284	002238	天威视讯	1,524	18,135.60	0.10
285	002218	拓日新能	1,854	18,057.96	0.10
286	002245	澳洋顺昌	2,000	18,040.00	0.10
287	002656	摩登大道	1,040	17,981.60	0.10
288	002240	威华股份	1,529	17,965.75	0.10
289	002522	浙江众成	1,088	17,788.80	0.10
290	002325	洪涛股份	2,433	17,760.90	0.10
291	002016	世荣兆业	1,866	17,652.36	0.10
292	002062	宏润建设	2,953	17,599.88	0.10
293	002520	日发精机	1,834	17,569.72	0.10
294	002097	山河智能	1,976	17,566.64	0.10
295	002023	海特高新	1,710	17,561.70	0.10
296	002121	科陆电子	2,035	17,501.00	0.10
297	002320	海峡股份	1,233	17,483.94	0.10
298	002010	传化智联	1,144	17,457.44	0.10
299	002620	瑞和股份	416	17,434.56	0.10
300	002519	银河电子	2,210	17,392.70	0.10
301	002095	生意宝	500	17,280.00	0.10
302	002318	久立特材	2,100	17,178.00	0.09
303	002100	天康生物	2,136	17,152.08	0.09
304	002181	粤传媒	3,167	17,133.47	0.09
305	002317	众生药业	1,378	17,114.76	0.09
306	002472	双环传动	1,558	17,091.26	0.09

307	002140	东华科技	1,293	17,002.95	0.09
308	002256	兆新股份	3,848	16,892.72	0.09
309	002628	成都路桥	2,468	16,856.44	0.09
310	002367	康力电梯	1,442	16,842.56	0.09
311	002226	江南化工	2,392	16,839.68	0.09
312	002581	未名医药	822	16,809.90	0.09
313	002079	苏州固锔	2,274	16,759.38	0.09
314	002564	天沃科技	1,818	16,598.34	0.09
315	002148	北纬通信	1,540	16,585.80	0.09
316	002300	太阳电缆	1,416	16,581.36	0.09
317	002171	楚江新材	1,109	16,446.47	0.09
318	002099	海翔药业	2,468	16,436.88	0.09
319	002068	黑猫股份	1,948	16,382.68	0.09
320	002123	梦网荣信	1,470	16,331.70	0.09
321	002394	联发股份	1,108	16,320.84	0.09
322	002418	康盛股份	1,751	16,301.81	0.09
323	002661	克明面业	1,000	16,230.00	0.09
324	002060	粤水电	3,858	16,165.02	0.09
325	002348	高乐股份	2,300	16,123.00	0.09
326	002474	榕基软件	1,485	16,112.25	0.09
327	002215	诺普信	1,900	16,074.00	0.09
328	002457	青龙管业	900	16,020.00	0.09
329	002596	海南瑞泽	1,932	16,016.28	0.09
330	002039	黔源电力	1,100	15,994.00	0.09
331	002054	德美化工	1,031	15,980.50	0.09
332	002314	南山控股	2,382	15,935.58	0.09
333	002627	宜昌交运	863	15,870.57	0.09
334	002216	三全食品	1,842	15,859.62	0.09
335	002565	顺灏股份	2,119	15,786.55	0.09
336	002540	亚太科技	2,230	15,743.80	0.09
337	002180	纳思达	650	15,704.00	0.09
338	002390	信邦制药	1,800	15,678.00	0.09
339	002471	中超控股	3,200	15,648.00	0.09
340	002550	千红制药	2,632	15,634.08	0.09
341	002170	芭田股份	2,089	15,521.27	0.09
342	002321	华英农业	1,405	15,426.90	0.09
343	002556	辉隆股份	2,113	15,403.77	0.08
344	002151	北斗星通	550	15,372.50	0.08
345	002005	德豪润达	3,211	15,316.47	0.08
346	002356	赫美集团	602	15,296.82	0.08
347	002588	史丹利	1,980	15,226.20	0.08
348	002590	万安科技	1,086	15,214.86	0.08
349	002228	合兴包装	3,264	15,210.24	0.08
350	002364	中恒电气	1,100	15,059.00	0.08

351	002609	捷顺科技	1,000	14,970.00	0.08
352	002649	博彦科技	1,350	14,890.50	0.08
353	002073	软控股份	1,755	14,882.40	0.08
354	002574	明牌珠宝	1,696	14,755.20	0.08
355	002365	永安药业	486	14,706.36	0.08
356	002167	东方锆业	1,337	14,680.26	0.08
357	002232	启明信息	1,207	14,677.12	0.08
358	002003	伟星股份	1,400	14,630.00	0.08
359	002425	凯撒文化	1,600	14,624.00	0.08
360	002502	骅威文化	1,552	14,573.28	0.08
361	002641	永高股份	2,778	14,528.94	0.08
362	002692	睿康股份	1,480	14,504.00	0.08
363	002476	宝莫股份	1,859	14,500.20	0.08
364	002538	司尔特	1,600	14,384.00	0.08
365	002371	北方华创	600	14,352.00	0.08
366	002224	三力士	1,285	14,263.50	0.08
367	002139	拓邦股份	1,324	14,259.48	0.08
368	002386	天原集团	1,997	14,238.61	0.08
369	002063	远光软件	1,352	14,087.84	0.08
370	002135	东南网架	1,771	14,044.03	0.08
371	002014	永新股份	1,107	13,959.27	0.08
372	002141	贤丰控股	1,946	13,913.90	0.08
373	002523	天桥起重	2,583	13,741.56	0.08
374	002432	九安医疗	1,191	13,732.23	0.08
375	002322	理工环科	571	13,681.16	0.08
376	002157	正邦科技	3,000	13,650.00	0.08
377	002208	合肥城建	1,045	13,585.00	0.07
378	002584	西陇科学	985	13,563.45	0.07
379	002107	沃华医药	1,069	13,362.50	0.07
380	002568	百润股份	800	13,296.00	0.07
381	002636	金安国纪	768	13,263.36	0.07
382	002096	南岭民爆	1,269	13,248.36	0.07
383	002193	如意集团	900	13,230.00	0.07
384	002182	云海金属	1,436	13,196.84	0.07
385	002521	齐峰新材	1,334	13,179.92	0.07
386	002350	北京科锐	850	13,166.50	0.07
387	002548	金新农	1,081	13,058.48	0.07
388	002309	中利集团	1,042	13,035.42	0.07
389	002037	久联发展	963	13,019.76	0.07
390	002488	金固股份	1,125	13,016.25	0.07
391	002654	万润科技	1,400	12,992.00	0.07
392	002528	英飞拓	2,178	12,915.54	0.07
393	002298	中电鑫龙	1,188	12,913.56	0.07
394	002539	云图控股	1,452	12,632.40	0.07

395	002605	姚记扑克	893	12,448.42	0.07
396	002398	建研集团	967	12,435.62	0.07
397	002154	报喜鸟	3,343	12,402.53	0.07
398	002377	国创高新	1,266	12,356.16	0.07
399	002494	华斯股份	846	12,334.68	0.07
400	002327	富安娜	1,482	12,315.42	0.07
401	002355	兴民智通	1,200	12,276.00	0.07
402	002070	*ST众和	1,200	12,204.00	0.07
403	002545	东方铁塔	995	12,188.75	0.07
404	002392	北京利尔	2,018	11,966.74	0.07
405	002527	新时达	1,124	11,948.12	0.07
406	002101	广东鸿图	500	11,945.00	0.07
407	002533	金杯电工	1,569	11,861.64	0.07
408	002006	精功科技	1,498	11,849.18	0.07
409	002369	卓翼科技	1,367	11,810.88	0.07
410	002339	积成电子	865	11,798.60	0.07
411	002087	新野纺织	2,082	11,763.30	0.06
412	002362	汉王科技	572	11,617.32	0.06
413	002546	新联电子	1,937	11,525.15	0.06
414	002483	润邦股份	1,739	11,460.01	0.06
415	002363	隆基机械	1,200	11,340.00	0.06
416	002177	御银股份	1,951	11,081.68	0.06
417	002478	常宝股份	2,000	11,060.00	0.06
418	002459	天业通联	700	11,060.00	0.06
419	002052	同洲电子	1,741	11,037.94	0.06
420	002559	亚威股份	999	10,869.12	0.06
421	002554	惠博普	1,806	10,655.40	0.06
422	002417	三元达	686	10,633.00	0.06
423	002441	众业达	918	10,612.08	0.06
424	002541	鸿路钢构	600	10,374.00	0.06
425	002404	嘉欣丝绸	1,338	10,315.98	0.06
426	002504	*ST弘高	1,273	10,311.30	0.06
427	002391	长青股份	700	10,248.00	0.06
428	002587	奥拓电子	1,350	10,179.00	0.06
429	002077	大港股份	910	10,101.00	0.06
430	002420	毅昌股份	1,200	10,092.00	0.06
431	002197	证通电子	800	10,048.00	0.06
432	002220	天宝股份	1,192	10,036.64	0.06
433	002406	远东传动	1,236	9,999.24	0.06
434	002536	西泵股份	800	9,904.00	0.05
435	002124	天邦股份	1,143	9,898.38	0.05
436	002516	旷达科技	1,800	9,882.00	0.05
437	002674	兴业科技	781	9,809.36	0.05
438	002201	九鼎新材	1,040	9,807.20	0.05

439	002374	丽鹏股份	1,620	9,525.60	0.05
440	002495	佳隆股份	2,060	9,414.20	0.05
441	002682	龙洲股份	700	9,345.00	0.05
442	002631	德尔未来	628	9,250.44	0.05
443	002535	林州重机	1,751	9,245.28	0.05
444	002455	百川股份	940	9,212.00	0.05
445	002165	红宝丽	1,466	9,074.54	0.05
446	002088	鲁阳节能	750	8,977.50	0.05
447	002071	长城影视	851	8,475.96	0.05
448	002328	新朋股份	1,011	8,360.97	0.05
449	002360	同德化工	1,001	8,238.23	0.05
450	002347	泰尔股份	1,096	8,132.32	0.04
451	002593	日上集团	1,546	8,131.96	0.04
452	002295	精艺股份	585	8,119.80	0.04
453	002209	达意隆	600	8,028.00	0.04
454	002693	双成药业	1,200	8,004.00	0.04
455	002160	常铝股份	1,100	7,832.00	0.04
456	002591	恒大高新	500	7,665.00	0.04
457	002231	奥维通信	700	7,518.00	0.04
458	002211	宏达新材	899	7,434.73	0.04
459	002667	鞍重股份	386	7,191.18	0.04
460	002580	圣阳股份	885	7,071.15	0.04
461	002452	长高集团	1,000	6,870.00	0.04
462	002629	仁智股份	919	6,800.60	0.04
463	002144	宏达高科	400	6,800.00	0.04
464	002381	双箭股份	700	6,118.00	0.03
465	002797	第一创业	640	5,894.40	0.03

7.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	002415	海康威视	198,749.00	0.63
2	002252	上海莱士	153,425.00	0.49
3	002370	亚太药业	147,183.00	0.47
4	002304	洋河股份	139,651.00	0.44
5	002465	海格通信	126,018.00	0.40

6	002012	凯恩股份	119,095.00	0.38
7	002183	怡亚通	109,364.00	0.35
8	002511	中顺洁柔	108,669.00	0.34
9	002739	万达电影	102,311.00	0.32
10	002142	宁波银行	101,686.00	0.32
11	002049	紫光国芯	100,203.00	0.32
12	002223	鱼跃医疗	99,846.00	0.32
13	002292	奥飞娱乐	96,250.00	0.30
14	002584	西陇科学	95,680.00	0.30
15	002361	神剑股份	95,450.00	0.30
16	002751	易尚展示	94,899.00	0.30
17	002086	东方海洋	94,770.00	0.30
18	002276	万马股份	94,582.00	0.30
19	002506	协鑫集成	93,199.00	0.30
20	002657	中科金财	89,760.00	0.28

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	002370	亚太药业	505,804.00	1.60
2	002415	海康威视	486,965.00	1.54
3	002304	洋河股份	369,351.00	1.17
4	002511	中顺洁柔	363,534.00	1.15
5	002465	海格通信	329,585.00	1.04
6	002223	鱼跃医疗	327,749.00	1.04
7	002252	上海莱士	299,952.58	0.95
8	002142	宁波银行	220,701.00	0.70
9	002024	苏宁云商	202,177.00	0.64
10	002450	康得新	182,812.00	0.58
11	002241	歌尔股份	157,637.00	0.50
12	002086	东方海洋	154,161.52	0.49
13	002475	立讯精密	142,297.00	0.45
14	002594	比亚迪	134,046.00	0.42
15	002695	煌上煌	133,646.00	0.42
16	002219	恒康医疗	133,222.50	0.42
17	002584	西陇科学	120,153.00	0.38
18	002493	荣盛石化	116,917.96	0.37
19	002186	全聚德	113,326.00	0.36
20	002461	珠江啤酒	109,097.00	0.35

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,647,117.39
卖出股票的收入（成交）总额	21,914,331.64

注：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投资。

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投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

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，没有相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出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	8,319.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	430.92
5	应收申购款	496.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,247.07

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

7.12.5.1 期末指数投资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	002049	紫光国芯	311,282.00	1.72	重大事项
2	002252	上海莱士	230,736.00	1.27	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

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
1,148	15,254.53	2,880,581.00	16.45%	14,631,624.20	83.55%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中银保险有限公司—传统保险产品	2,796,973.00	15.97%
2	郑淑女	932,651.00	5.33%
3	李锦山	543,778.00	3.11%
4	王慧娟	457,275.14	2.61%
5	李妍	452,404.19	2.58%
6	司明辉	366,409.52	2.09%
7	朱洪宏	348,595.00	1.99%
8	张莉凤	333,721.53	1.91%
9	宗祥芬	261,605.37	1.49%
10	陈斌	233,494.47	1.33%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 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	502.16	0.00%
------------------	--------	-------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	29,993,045.51
本报告期基金总申购份额	9,297,270.16
减：本报告期基金总赎回份额	21,778,110.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,512,205.20

10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内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

- 1、本报告期基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生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

本报告期内基金未有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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	32,554,723.30	100.00%	29,667.43	100.00%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 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。

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

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 研究报告被基金采纳的情况；

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；

- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

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
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持海兰信股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-14
2	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持国药股份和麦捷科技股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-18
3	国联安基金管理有限公司关于开展网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-26
4	2016年国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)四季报	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2017-01-21
5	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017-02-23
6	国联安基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-23
7	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2016年年报	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-28
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-01
9	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加广发证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-10
10	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持康尼机电股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-13
11	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2017年一季度报告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-22
12	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-24
13	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宣亚国际股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-26
14	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	深交所、中国证券报、证券时报、公司网站	2017-05-06
15	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持华铭智能股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-25
16	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万盛股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-03
17	国联安基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-16
18	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持索菱股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
个人	1	2017年1月1日至2017年2月22日	12,283,100.44	7,459,329.44	19,742,429.88	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)发行及募集的文件
- 2、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.gtja-allianz.com 或 www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日