

招商优质成长混合型证券投资基金（LOF） 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	37
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.11 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息	39

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
8.2 期末上市基金前十名持有人	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
§9 开放式基金份额变动.....	39
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§11 备查文件目录.....	43
11.1 备查文件目录	43
11.2 存放地点	44
11.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	招商优质成长混合（LOF）（场内简称：招商成长）
基金主代码	161706
前端交易代码	161706
后端交易代码	161707
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005 年 11 月 17 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	834,473,046.34 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	2005-12-09

2.2 基金产品说明

投资目标	精选受益于中国经济成长的优秀企业，进行积极主动的投资管理，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。
投资策略	资产配置方面，本基金股票投资比例为 75%-95%，债券及现金投资比例为 5%-25%（其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%）。本基金为混合型基金，以股票投资为主，因而在一般情况下，本基金不太进行大类资产配置，股票投资保持相对较高的比例。本基金的股票资产将投资于管理人认为具有优质成长性并且较高相对投资价值的股票；在本基金认为股票市场投资风险非常大时，将会有一定的债券投资比例，债券投资采用主动的投资管理，获得与风险相匹配的收益率，同时保证组合的流动性满足正常的现金流的需要。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金属于主动管理的混合型基金，精选价值被低估的具有优质成长特性的个股进行积极投资，属于预期风险和预期收益相对较高的证券投资基金品种，本基金力争在严格控制风险的前提下为投资人谋求资本的长期稳定增值。

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		招商基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里	方韡
	联系电话	0755-83196666	010-89936330
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-887-9555	95558
传真		0755-83196475	010-85230024
注册地址		深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
办公地址		中国深圳深南大道 7088 号 招商银行大厦	北京市东城区朝阳门北大街 9 号
邮政编码		518040	100010
法定代表人		李浩	常振明

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cmfchina.com
基金半年度报告备置地点	（1）招商基金管理有限公司 地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 （2）中信银行股份有限公司 地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

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	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-212,346,961.56
本期利润	-261,113,541.37
加权平均基金份额本期利润	-0.3092
本期加权平均净值利润率	-21.63%

本期基金份额净值增长率	-17.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	858,434,607.29
期末可供分配基金份额利润	1.0287
期末基金资产净值	1,219,630,352.25
期末基金份额净值	1.4616
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	395.00%

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

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

3、期末可供分配利润等于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

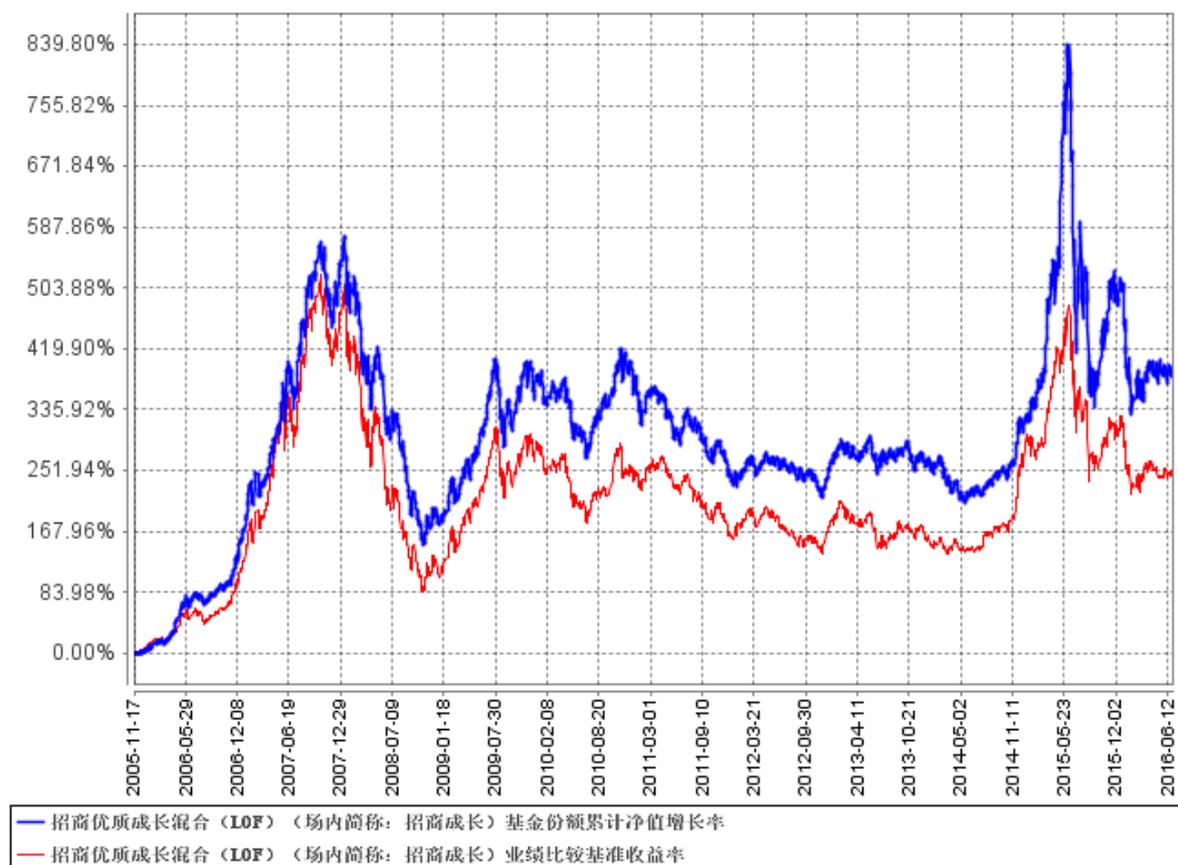
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.34%	1.35%	-0.46%	0.93%	0.80%	0.42%
过去三个月	0.23%	1.35%	-1.87%	0.96%	2.10%	0.39%
过去六个月	-17.47%	2.21%	-14.65%	1.75%	-2.82%	0.46%
过去一年	-25.98%	2.75%	-27.99%	2.19%	2.01%	0.56%
过去三年	38.87%	2.10%	41.77%	1.75%	-2.90%	0.35%
自基金合同生效起至今	395.00%	1.78%	251.80%	1.81%	143.20%	-0.03%

注：业绩比较基准收益率=95%×沪深300指数+5%×同业存款利率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

招商优质成长混合（LOF）（场内简称：招商成长）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：根据基金合同第十四条（三）投资方向的规定：本基金投资股票的比例为 75-95%，投资债券及现金的比例为 5-25%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金于 2005 年 11 月 17 日成立，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时（2006 年 5 月 16 日）相关比例均符合上述规定的要求。

§ 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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会（2002）100 号文批准设立。目前，公司注册资本为 2.1 亿元人民币，其中，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 只共同基金，具体如下：

基金名称	基金类型	基金成立日
招商安泰偏股混合型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰平衡型证券投资基金	混合型基金	2003-04-28
招商安泰债券投资基金	债券型基金	2003-04-28
招商现金增值开放式证券投资基金	货币市场型基金	2004-01-14
招商先锋证券投资基金	混合型基金	2004-06-01
招商优质成长混合型证券投资基金	混合型基金	2005-11-17
招商安本增利债券型证券投资基金	债券型基金	2006-07-11
招商核心价值混合型证券投资基金	混合型基金	2007-03-30
招商大盘蓝筹混合型证券投资基金	混合型基金	2008-06-19
招商安心收益债券型证券投资基金	债券型基金	2008-10-22
招商行业领先混合型证券投资基金	混合型基金	2009-06-19
招商中小盘精选混合型证券投资基金	混合型基金	2009-12-25
招商全球资源股票型证券投资基金	国际(QDII)基金	2010-03-25
招商深证 100 指数证券投资基金	股票型基金	2010-06-22
招商信用添利债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2010-06-25
上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2010-12-08
招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型基金	2010-12-08
招商标普金砖四国指数证券投资基金(LOF)	国际(QDII)基金	2011-02-11
招商安瑞进取债券型证券投资基金	债券型基金	2011-03-17
深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金	股票型基金	2011-06-27
招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型基金	2011-06-27
招商安达保本混合型证券投资基金	混合型基金	2011-09-01
招商优势企业灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2012-02-01
招商产业债券型证券投资基金	债券型基金	2012-03-21
招商中证大宗商品股票指数分级证券投资基金	股票型基金	2012-06-28
招商信用增强债券型证券投资基金	债券型基金	2012-07-20
招商安盈保本混合型证券投资基金	混合型基金	2012-08-20
招商理财 7 天债券型证券投资基金	货币市场型基金	2012-12-07
招商央视财经 50 指数证券投资基金	股票型基金	2013-02-05
招商双债增强债券型证券投资基金(LOF)	债券型基金	2013-03-01
招商安润保本混合型证券投资基金	混合型基金	2013-04-19
招商保证金快线货币市场基金	货币市场型基金	2013-05-17
招商沪深 300 高贝塔指数分级证券投资基金	股票型基金	2013-08-01
招商瑞丰灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2013-11-06
招商标普高收益红利贵族指数增强型证券投资基金	国际(QDII)基金	2013-12-11
招商丰盛稳定增长灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-03-20

招商招钱宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-03-25
招商招金宝货币市场基金	货币市场型基金	2014-06-18
招商可转债分级债券型证券投资基金	债券型基金	2014-07-31
招商丰利灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2014-08-12
招商行业精选股票型证券投资基金	股票型基金	2014-09-03
招商招利 1 个月理财债券型证券投资基金	货币市场型基金	2014-09-25
招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-13
招商沪深 300 地产等权重指数分级证券投资基金	股票型基金	2014-11-27
招商医药健康产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-01-30
招商丰泰灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)	混合型基金	2015-04-17
招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商中证银行指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-20
招商国证生物医药指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商中证白酒指数分级证券投资基金	股票型基金	2015-05-27
招商丰泽灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-11
招商移动互联网产业股票型证券投资基金	股票型基金	2015-06-19
招商国企改革主题混合型证券投资基金	混合型基金	2015-06-29
招商安益保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-07-14
招商丰庆灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型基金	2015-07-31
招商体育文化休闲股票型证券投资基金	股票型基金	2015-08-18
招商丰融灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰裕灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商丰享灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-11-17
招商制造业转型灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-02
招商境远保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-15
招商招益一年定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2015-12-25
招商安弘保本混合型证券投资基金	混合型基金	2015-12-29
招商康泰养老灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-02-04
招商安德保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-02-18
招商安元保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-03-01
招商招瑞纯债债券型发起式证券投资基金	债券型基金	2016-03-09
招商量化精选股票型发起式证券投资基金	股票型基金	2016-03-15
招商睿逸稳健配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-04-13
招商招兴纯债债券型证券投资基金	债券型基金	2016-05-18
招商安博保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-05-25
招商招盈 18 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型基金	2016-06-01
招商增荣灵活配置混合型证券投资基金	混合型基金	2016-06-03
招商招恒纯债债券型证券投资基金	债券型基金	2016-06-08
招商安裕保本混合型证券投资基金	混合型基金	2016-06-20
招商财富宝交易型货币市场基金	货币型基金	2016-06-30

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王忠波	本基金的基金经理	2014年6月13日	-	16	男，博士，高级会计师。曾就职于山东省财政厅、山东证券有限责任公司及山东资产管理公司。2000年5月起加入深圳证券交易所，从事证券研究工作。2002年6月加入银河基金管理有限公司，历任研究部宏观策略与行业研究员、副总监、总监等职务，曾担任银河稳健证券投资基金、银河行业优选基金经理。2010年12月加盟国联安基金管理有限公司，任总经理助理兼研究总监职务。2014年4月加盟招商基金管理有限公司，曾任招商行业领先混合型证券投资基金基金经理，现任总经理助理、投资管理四部部门负责人兼招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）、招商行业精选股票型证券投资基金及招商移动互联网产业股票型证券投资基金基金经理。
孙振锋	本基金的基金经理	2016年1月20日	-	12	男，经济学博士。2004年加入银河基金管理有限公司，曾任研究部研究员、股票投资部基金经理助理、基金经理；2011年加入华夏基金管理有限公司，曾任股票投资部基金经理；2015年8月加入招商基金管理有限公司，现任招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）及招商中小盘精选混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人（以下简称“公司”）已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。公司交易部在报告期内，本着持有人利益最大化的原则执行了公平交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内，公司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，在某指数型投资组合与某主动型投资组合之间发生过两次，原因是指数型投资组合为满足指数复制比例要求的投资策略需要。报告期内未发现其他有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

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

上半年国际市场经历了风险偏好剧烈波动，美元加息预期不断减弱，以原油为代表的大宗商品表现突出，英国脱欧等事件对全球市场产生重大冲击。国内经济表现平稳但下行压力仍大，除基建投资之外的数据大多逊于预期，货币流动性环境整体宽裕，人民币有序贬值。整体而言，中国经济仍然处于寻底阶段，调结构、稳增长的压力较大，政策鼓励去杠杆、去库存等的措施有助于短期经济企稳。报告期内沪深 300 指数下跌 15.47%，业绩稳定的食品饮料、家电、农业等防御板块有不错的表现，新能源汽车相关产业链、电子半导体等是也有阶段性表现，其它大多行业较为平淡。

本基金上半年维持了中性仓位，一季度对持仓结构做了较大调整，主要减持了估值偏高的成长股，增持了禽养殖、饲料等农业、消费品龙头公司以及受益于涨价的一些偏周期板块，基本完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.4616 元，本报告期份额净值增长率为-17.47%，同期业绩比较基准增长率为-14.65%，基金净值表现差于业绩比较基准，幅度为 2.82%，主要原因是：年初市场快速下跌过程中组合结构偏离基准，导致净值调整幅度较大。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际环境来看，自年初以来汇率大幅波动对于全球金融市场的冲击进一步显现，反映的是全球货币宽松逻辑的变局。从周期的角度来看，全球低利率已经到了极限，美联储的加息缓慢是美国平衡风险的需要，全球风险资产面临宽松退出下的不确定性。中国经济仍然处于寻底阶段，经济短期无忧，结构存虑，民间投资下行，尚未看到中期新增长点，对于转型的信心仍有待进一步加强。A 股市场经历过几轮下跌之后，权益类资产大部分风险已经得到释放，未来进一步调整的空间有限，但系统性回升可能需要一定的时间和基本面的配合。目前的宏观背景难以支持 2016 年 A 股市场出现趋势性上升或下跌行情，大幅波动区间震荡的可能较大。本基金将坚持稳健风格，基于产业链研究挖掘投资方向，寻找确定性机会，自下而上重点优选高景气的行业和公司，分享优质企业高速成长带来的收益，在合理估值水平下买入配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理制度》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估

值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场和交易所市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期无需进行利润分配。本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

根据证监会《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的相关要求，基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

自 2005 年 11 月 17 日招商优质成长混合型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 成立以来, 作为本基金的托管人, 中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定, 尽职尽责地履行了托管人应尽的义务, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内, 本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求, 对基金管理人—招商基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督, 对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期, 本基金未进行分红, 本托管人按照基金合同要求进行了严格审核, 符合基金合同相关约定。

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

由本基金管理人—招商基金管理有限公司编制, 并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 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：招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	123,514,638.02	295,651,326.13
结算备付金		1,869,080.43	6,392,153.05
存出保证金		1,914,937.36	1,733,903.54
交易性金融资产	6.4.7.2	1,096,556,401.61	1,232,403,693.30
其中：股票投资		1,096,556,401.61	1,232,403,693.30
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		96,075.25	-
应收利息	6.4.7.5	38,318.26	64,520.72
应收股利		-	-
应收申购款		123,455.44	50,325.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,224,112,906.37	1,536,295,922.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	30,439,835.21
应付赎回款		1,375,302.85	1,692,663.18
应付管理人报酬		1,487,671.68	1,921,408.47
应付托管费		247,945.30	320,234.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,185,047.44	4,099,084.53
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	186,586.85	202,619.67
负债合计		4,482,554.12	38,675,845.79
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	361,195,744.96	366,042,950.29
未分配利润	6.4.7.10	858,434,607.29	1,131,577,126.65
所有者权益合计		1,219,630,352.25	1,497,620,076.94
负债和所有者权益总计		1,224,112,906.37	1,536,295,922.73

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.4616元，基金份额总额834,473,046.34份。

6.2 利润表

会计主体：招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日

一、收入		-243,493,553.90	1,497,811,275.03
1.利息收入		833,405.51	2,243,940.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	833,405.51	1,135,754.39
债券利息收入		-	1,108,186.38
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）		-195,592,255.46	1,391,097,942.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-198,432,552.12	1,385,218,775.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	1,986,430.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	2,840,296.66	3,892,736.79
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-48,766,579.81	103,220,733.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	31,875.86	1,248,658.11
减：二、费用		17,619,987.47	47,905,937.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,002,418.06	21,331,111.50
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,500,403.08	3,555,185.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	6,925,501.40	22,818,413.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	191,664.93	201,226.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-261,113,541.37	1,449,905,337.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-261,113,541.37	1,449,905,337.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）

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）	366,042,950.29	1,131,577,126.65	1,497,620,076.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-261,113,541.37	-261,113,541.37
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）	-4,847,205.33	-12,028,977.99	-16,876,183.32
其中：1.基金申购款	14,077,005.71	32,166,264.00	46,243,269.71
2.基金赎回款	-18,924,211.04	-44,195,241.99	-63,119,453.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	361,195,744.96	858,434,607.29	1,219,630,352.25
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）	925,355,433.09	1,759,875,390.61	2,685,230,823.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,449,905,337.79	1,449,905,337.79
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）	-507,976,529.76	-1,723,094,234.53	-2,231,070,764.29
其中：1.基金申购款	134,739,945.94	426,992,176.79	561,732,122.73
2.基金赎回款	-642,716,475.70	-2,150,086,411.32	-2,792,802,887.02
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	417,378,903.33	1,486,686,493.87	1,904,065,397.20

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：

金旭

欧志明

何剑萍

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)(原名招商优质成长股票型证券投资基金(LOF),以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,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[2005]137号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为653,405,124.62份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(05)第0044号验资报告。基金合同于2005年11月17日正式生效。本基金因自2007年7月1日起执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”),于2007年9月28日公告了修改后的基金合同。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。本基金于2015年7月27日起更名为招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第100号文审核同意,本基金67,790,448份基金份额于2005年12月09日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《招商基金管理有限公司关于招商优质成长股票型证券投资基金(LOF)基金份额拆分比例的公告》,本基金管理人于2007年03月22日对本基金进行基金份额拆分。根据拆分前基金份额净值和公告的基金份额拆分比例计算公式,基金份额拆分比例为1:2.310328237(保留到小数点后9位),拆分后的基金份额净值为1.0000元。本基金注册登记机构于2007年03月23日对各基金份额持有人经重新计算的基金份额进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、修改后的基金合同及最新公告的《招商优质成长混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》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,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票的主要投资对象是本基金的基金管理人认为具有良好盈利成长性,同时价值被市场低估的具有较高相对投资价值的股票。债券的主要投资对象是本基金的基金管理人认为具有相对投资价值的固定收益品种,包括国债、金融债、企业(公司)债与可转换债等。基金的投资组合为:股票投资占基金资产的比例为75% - 95%,债券及现金投资比例为5% - 25%(其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于5%)。本基金至少有80%以上的非现金基金资产将投资于本基金名称所显示

的投资方向。本基金的业绩比较基准采用： $95\% \times$ 沪深 300 指数 $+5\% \times$ 同业存款利率。

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颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内未发生重大会计差错更正。

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[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》、财税[2008]1 号《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》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 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、债券免征营业税和增值税。
- 3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
- 5) 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税。
- 6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- 7) 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、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	123,514,638.02
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	123,514,638.02

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	1,017,842,398.50	1,096,556,401.61	78,714,003.11
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	1,017,842,398.50	1,096,556,401.61	78,714,003.11

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	36,785.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	756.99
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	775.53
合计	38,318.26

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,185,047.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,185,047.44

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	7,573.47
预提费用	179,013.38
合计	186,586.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	845,671,536.90	366,042,950.29
本期申购	32,522,134.60	14,077,005.71
本期赎回(以“-”号填列)	-43,720,625.16	-18,924,211.04
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	834,473,046.34	361,195,744.96

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	1,204,831,405.38	-73,254,278.73	1,131,577,126.65
本期利润	-212,346,961.56	-48,766,579.81	-261,113,541.37
本期基金份额交易产生的变动数	-13,208,509.70	1,179,531.71	-12,028,977.99
其中：基金申购款	41,019,540.78	-8,853,276.78	32,166,264.00

基金赎回款	-54,228,050.48	10,032,808.49	-44,195,241.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	979,275,934.12	-120,841,326.83	858,434,607.29

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	776,156.27
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	39,006.79
其他	18,242.45
合计	833,405.51

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	2,241,120,684.09
减：卖出股票成本总额	2,439,553,236.21
买卖股票差价收入	-198,432,552.12

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生金融工具收益。

6.4.7.17 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	2,840,296.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,840,296.66

6.4.7.18 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	-48,766,579.81
——股票投资	-48,766,579.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-48,766,579.81

6.4.7.19 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	31,875.68
转换转出收入	0.18
合计	31,875.86

注：1、本基金的赎回费率按基金持有人持有该部分基金份额的时间分段递减设定，于持有人赎回基金份额时收取，赎回费总额按一定比例归入基金资产；

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中赎回费总额按一定比例归入转出基金的基金资产。

6.4.7.20 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	6,925,501.40

银行间市场交易费用	-
合计	6,925,501.40

6.4.7.21 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	99,452.08
银行费用	3,451.55
上市费	29,835.26
其他	9,200.00
上市年费	-
合计	191,664.93

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

本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
招商证券	520,410,783.99	11.33%	1,147,370,723.89	8.02%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	484,656.67	11.33%	44,038.18	3.72%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	1,044,563.90	8.02%	260,532.03	5.04%

注：1、本基金与关联方的所有交易均是在正常业务中按照一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	9,002,418.06
其中：支付销售机构的客	889,554.35	1,783,276.95

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人招商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,500,403.08	3,555,185.24

注：支付基金托管人中信银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
中信银行	123,514,638.02	776,156.27	317,851,543.39	990,404.49

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	9,862	128,008.76	128,008.76	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：权证										
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：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000835	长城动漫	2016年2月29日	重大事项	14.15	2016年7月22日	14.54	1,484,744	24,709,120.91	21,009,127.60	-
601611	中国核建	2016年6月30日	重大事项	20.92	2016年7月1日	23.01	30,252	104,974.44	632,871.84	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资和权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作使本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要包括市场价格风险和利率风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人中信银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券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。

对于与债券投资相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 及 6.4.13.2.2 列示了于本报告期末及上年度末本基金所持有的债券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指没有足够资金以满足到期债务支付的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产款外，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息。

本基金为 LOF 基金，上市交易在一定程度上降低了兑付赎回的流动性风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是银行存款、债券投资与买入返售金融资产。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	123,514,638.02	-	-	-	-	-	123,514,638.02
结算备付金	1,869,080.43	-	-	-	-	-	1,869,080.43
存出保证金	1,914,937.36	-	-	-	-	-	1,914,937.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,096,556,401.61	1,096,556,401.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	96,075.25	96,075.25
应收利息	-	-	-	-	-	38,318.26	38,318.26
应收申购款	-	-	-	-	-	123,455.44	123,455.44

资产总计	127,298,655.81	-	-	-	-	-1,096,814,250.56	1,224,112,906.37
负债							
应付赎回款						1,375,302.85	1,375,302.85
应付管理人报酬						1,487,671.68	1,487,671.68
应付托管费						247,945.30	247,945.30
应付交易费用						1,185,047.44	1,185,047.44
其他负债						186,586.85	186,586.85
负债总计						4,482,554.12	4,482,554.12
利率敏感度缺口	127,298,655.81					-1,092,331,696.44	1,219,630,352.25
上年度末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	295,651,326.13						295,651,326.13
结算备付金	6,392,153.05						6,392,153.05
存出保证金	1,733,903.54						1,733,903.54
交易性金融资产						-1,232,403,693.30	1,232,403,693.30
应收利息						64,520.72	64,520.72
应收申购款						50,325.99	50,325.99
资产总计	303,777,382.72					-1,232,518,540.01	1,536,295,922.73
负债							
应付证券清算款						30,439,835.21	30,439,835.21
应付赎回款						1,692,663.18	1,692,663.18
应付管理人报酬						1,921,408.47	1,921,408.47
应付托管费						320,234.73	320,234.73
应付交易费用						4,099,084.53	4,099,084.53
其他负债						202,619.67	202,619.67
负债总计						38,675,845.79	38,675,845.79
利率敏感度缺口	303,777,382.72					-1,193,842,694.22	1,497,620,076.94

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资及资产支持证券投资，因此市场利率变动而导致的利率敏感性资产的公允价值变动对基金资产净值的影响不重大。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 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	1,096,556,401.61	89.91	1,232,403,693.30	82.29
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	1,096,556,401.61	89.91	1,232,403,693.30	82.29

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%		
	2. 其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 权益性投资的市场价格上升 5%	54,827,820.08	61,620,184.67
	2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-54,827,820.08	-61,620,184.67

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,096,556,401.61	89.58
	其中：股票	1,096,556,401.61	89.58
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	125,383,718.45	10.24
7	其他各项资产	2,172,786.31	0.18
8	合计	1,224,112,906.37	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	302,348,140.74	24.79
B	采矿业	77,009,544.74	6.31
C	制造业	474,781,771.52	38.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	43,106,342.18	3.53
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,142,108.40	5.10
J	金融业	49,355,428.00	4.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,302,480.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	36,717,879.47	3.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	33,772,580.46	2.77
	合计	1,096,556,401.61	89.91

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	002234	民和股份	2,808,218	82,589,691.38	6.77
2	002458	益生股份	1,858,727	81,430,829.87	6.68
3	002299	圣农发展	3,139,071	81,301,938.90	6.67
4	600395	盘江股份	8,400,049	69,384,404.74	5.69
5	002508	老板电器	1,639,719	60,292,467.63	4.94
6	002714	牧原股份	1,015,903	51,333,578.59	4.21
7	002051	中工国际	2,159,302	42,473,470.34	3.48
8	600867	通化东宝	1,834,110	37,947,735.90	3.11
9	300015	爱尔眼科	997,199	36,427,679.47	2.99
10	300059	东方财富	1,623,780	36,047,916.00	2.96
11	600777	新潮实业	1,909,134	33,772,580.46	2.77
12	600688	上海石化	5,489,013	33,482,979.30	2.75
13	002157	正邦科技	1,321,146	30,994,085.16	2.54
14	002548	金新农	1,709,186	30,013,306.16	2.46
15	002385	大北农	3,696,835	29,796,490.10	2.44
16	601688	华泰证券	1,330,800	25,178,736.00	2.06
17	002049	紫光国芯	532,500	23,403,375.00	1.92
18	002353	杰瑞股份	1,187,650	22,897,892.00	1.88
19	000835	长城动漫	1,484,744	21,009,127.60	1.72
20	000848	承德露露	1,623,435	19,400,048.25	1.59
21	300236	上海新阳	359,600	18,192,164.00	1.49
22	002174	游族网络	565,500	18,096,000.00	1.48
23	603609	禾丰牧业	1,129,765	17,884,179.95	1.47
24	002027	分众传媒	1,048,000	17,302,480.00	1.42
25	600519	贵州茅台	48,900	14,274,888.00	1.17
26	600285	羚锐制药	1,180,900	12,741,911.00	1.04
27	000876	新希望	1,530,000	12,729,600.00	1.04
28	600328	兰太实业	1,043,839	12,546,944.78	1.03
29	002409	雅克科技	551,000	12,265,260.00	1.01
30	600276	恒瑞医药	304,039	12,195,004.29	1.00
31	002673	西部证券	468,600	12,117,996.00	0.99
32	601198	东兴证券	493,400	12,058,696.00	0.99
33	002341	新纶科技	551,700	11,878,101.00	0.97
34	300398	飞凯材料	152,700	11,421,960.00	0.94
35	002493	荣盛石化	720,759	8,735,599.08	0.72
36	002533	金杯电工	579,200	7,778,656.00	0.64
37	000983	西山煤电	935,600	7,625,140.00	0.63

38	002422	科伦药业	398,700	6,143,967.00	0.50
39	002405	四维图新	243,500	5,990,100.00	0.49
40	000998	隆平高科	299,900	5,692,102.00	0.47
41	600549	厦门钨业	112,800	3,351,288.00	0.27
42	600436	片仔癀	54,200	2,439,542.00	0.20
43	300017	网宿科技	20,000	1,344,000.00	0.11
44	601611	中国核建	30,252	632,871.84	0.05
45	300183	东软载波	22,400	593,600.00	0.05
46	300347	泰格医药	10,000	290,200.00	0.02
47	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.02
48	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.02
49	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.01
50	601966	玲珑轮胎	9,862	128,008.76	0.01
51	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.01
52	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
53	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.01
54	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
55	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
56	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
57	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
58	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
59	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002458	益生股份	80,219,417.32	5.36
2	600395	盘江股份	74,072,907.63	4.95
3	002714	牧原股份	70,719,259.60	4.72
4	002234	民和股份	59,508,556.79	3.97
5	002299	圣农发展	58,729,279.17	3.92
6	300058	蓝色光标	55,140,317.26	3.68
7	002353	杰瑞股份	54,515,682.52	3.64
8	600688	上海石化	50,344,725.65	3.36

9	000933	*ST 神火	48,975,057.27	3.27
10	002508	老板电器	47,115,224.88	3.15
11	002051	中工国际	45,918,217.79	3.07
12	002280	联络互动	43,432,953.47	2.90
13	601688	华泰证券	42,619,678.37	2.85
14	000018	神州长城	41,341,724.45	2.76
15	002400	省广股份	37,798,875.04	2.52
16	000807	云铝股份	36,591,494.83	2.44
17	300059	东方财富	35,538,863.13	2.37
18	601233	桐昆股份	33,640,139.00	2.25
19	002157	正邦科技	33,614,278.59	2.24
20	002493	荣盛石化	33,257,612.06	2.22
21	600777	新潮能源	32,456,410.27	2.17
22	002548	金新农	31,138,170.33	2.08
23	002001	新和成	30,589,063.54	2.04
24	000059	华锦股份	30,394,311.68	2.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”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	000018	神州长城	76,070,873.53	5.08
2	300017	网宿科技	55,114,308.26	3.68
3	600978	宜华生活	54,398,100.20	3.63
4	000933	*ST 神火	53,520,170.98	3.57
5	000807	云铝股份	49,404,994.00	3.30
6	600986	科达股份	41,823,898.24	2.79
7	002280	联络互动	41,554,992.61	2.77
8	300043	互动娱乐	38,089,941.03	2.54
9	300058	蓝色光标	37,932,071.93	2.53
10	002001	新和成	37,132,589.39	2.48
11	300113	顺网科技	35,321,562.50	2.36
12	600395	盘江股份	34,140,953.10	2.28
13	601336	新华保险	33,037,924.44	2.21

14	600559	老白干酒	32,919,834.10	2.20
15	002714	牧原股份	31,946,706.08	2.13
16	000059	华锦股份	31,880,039.36	2.13
17	002157	正邦科技	31,725,210.01	2.12
18	000558	莱茵体育	31,578,025.96	2.11
19	002400	省广股份	31,405,560.07	2.10
20	300198	纳川股份	30,619,547.41	2.04
21	002353	杰瑞股份	30,448,486.00	2.03
22	600487	亨通光电	30,260,367.29	2.02
23	601233	桐昆股份	30,008,268.80	2.00

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”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

买入股票成本（成交）总额	2,352,472,524.33
卖出股票收入（成交）总额	2,241,120,684.09

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.10.2 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合约。

7.10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金本报告期内投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2

本基金本报告期内投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本公司从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.11.3 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	1,914,937.36
2	应收证券清算款	96,075.25
3	应收股利	-
4	应收利息	38,318.26
5	应收申购款	123,455.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,172,786.31

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
51,122	16,323.17	1,511,503.22	0.18%	832,961,543.12	99.82%

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	姚乐音	2,130,052.00	8.28%
2	肖鹰	517,130.00	2.01%
3	单丽艳	259,500.00	1.01%
4	杨喜梅	240,000.00	0.93%
5	衣凤勇	220,085.00	0.86%
6	曾金华	202,800.00	0.79%
7	郭爱琴	196,935.00	0.77%
8	杨卓兴	185,907.00	0.72%
9	周秋忙	173,317.00	0.67%
10	王庭耀	172,150.00	0.67%
	合计	4,297,876.00	16.71%

注：以上数据由中国证券登记结算有限公司提供，持有人为场内持有人。

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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	114.60	0.0000%

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

基金合同生效日（2005年11月17日）基金份额总额	653,405,124.62
本报告期期初基金份额总额	845,671,536.90
本报告期基金总申购份额	32,522,134.60
减：本报告期基金总赎回份额	43,720,625.16
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	834,473,046.34

注：总申购份额含红利再投份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘用的会计师事务所无变化。

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，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员、托管人及其高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元数量	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	备注
海通证券	1	1,203,660,466.93	26.21%	1,120,971.62	26.21%	-
恒泰证券	1	853,844,505.55	18.59%	795,187.68	18.59%	-
申万宏源	1	672,709,532.63	14.65%	626,495.84	14.65%	-
招商证券	1	520,410,783.99	11.33%	484,656.67	11.33%	-
长城证券	1	508,242,221.23	11.07%	473,325.01	11.07%	-
中金公司	1	268,510,483.53	5.85%	250,065.02	5.85%	-
华龙证券	1	238,993,852.75	5.20%	222,577.12	5.20%	-
川财证券	1	156,511,994.19	3.41%	145,759.35	3.41%	-
渤海证券	1	136,863,895.61	2.98%	127,462.11	2.98%	-
光大证券	1	32,717,888.38	0.71%	30,469.78	0.71%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-

注：基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量以及销售服务质量打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

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

本基金本报告期未发生基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露时间
1	招商基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报	2016年1月4日

2	招商基金管理有限公司关于 1 月 4 日指数熔断触发旗下公募基金开放时间调整的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 4 日
3	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 5 日
4	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 6 日
5	招商基金管理有限公司关于 1 月 7 日指数熔断触发旗下公募基金开放时间调整的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 7 日
6	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 8 日
7	招商基金旗下部分基金增加乐融多源为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 8 日
8	关于招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 20 日
9	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2015 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 22 日
10	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 27 日
11	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安证券申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 29 日
12	招商基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购最低金额限制的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 1 月 29 日
13	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 2 月 26 日
14	招商基金管理有限公司关于旗下相关基金增加中信期货有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 3 月 1 日
15	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2015 年年度报告	中国证券报、上海证券报	2016 年 3 月 26 日
16	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2015 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报	2016 年 3 月 26 日
17	招商基金管理有限公司关于参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 3 月 31 日
18	关于招商基金旗下部分基金继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 4 月 1 日
19	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 4 月 6 日
20	招商基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 4 月 7 日

21	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报	2016 年 4 月 21 日
22	关于淘宝基金理财平台和支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 4 月 26 日
23	关于招商基金旗下部分基金参加中国民生银行基金通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 5 月 13 日
24	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加宁波银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 5 月 16 日
25	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与兴业证券股份有限公司申购场外开放式基金费率优惠及开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 6 月 1 日
26	招商基金管理有限公司关于旗下部分基金参与兴业证券股份有限公司申购场外开放式基金费率优惠及开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 6 月 16 日
27	招商基金管理有限公司关于旗下部分产品增加东莞农商银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 6 月 17 日
28	招商基金旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构及开通定投的公告	中国证券报、上海证券报	2016 年 6 月 28 日
29	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书（二零一六年第一号）	中国证券报、上海证券报	2016 年 6 月 29 日
30	招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）更新的招募说明书摘要（二零一六年第一号）	中国证券报、上海证券报	2016 年 6 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商优质成长股票型证券投资基金（LOF）设立的文件；
- 3、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 4、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 6、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年第 1 季度报告》；
- 7、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年第 2 季度报告》；
- 8、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年半年度报告》；

9、《招商优质成长混合型证券投资基金（LOF）2016 年半年度报告摘要》。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 28 层

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司
2016 年 8 月 24 日