

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

2016年半年度报告

2016年6月30日

基金管理人：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：二〇一六年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
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.....	9
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.....	10
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	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
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.....	44
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
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.....	47

8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
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.....	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录.....	55
11.2 存放地点.....	55
11.3 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	1,347,601,148.07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		上海市浦东新区陆家嘴环路 1318号星展银行大厦9楼	北京市西城区金融大街25号

办公地址	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318号星展银行大厦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	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	431,413.16
本期利润	-2,377,744.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0335
本期加权平均净值利润率	-2.28%
本期基金份额净值增长率	-13.87%
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	137,534,172.77
期末可供分配基金份额利润	0.1021
期末基金资产净值	1,398,267,174.58
期末基金份额净值	1.038
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	1.78%

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	2.85%	1.27%	5.32%	1.49%	-2.47%	-0.22%
过去三个月	1.02%	1.44%	3.64%	1.59%	-2.62%	-0.15%
过去六个月	-13.87%	2.27%	-13.39%	2.41%	-0.48%	-0.14%
过去一年	-19.77%	2.65%	-16.67%	2.62%	-3.10%	0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金份额转换日次日起至今	1.78%	2.69%	7.84%	2.63%	-6.06%	0.06%

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）”；

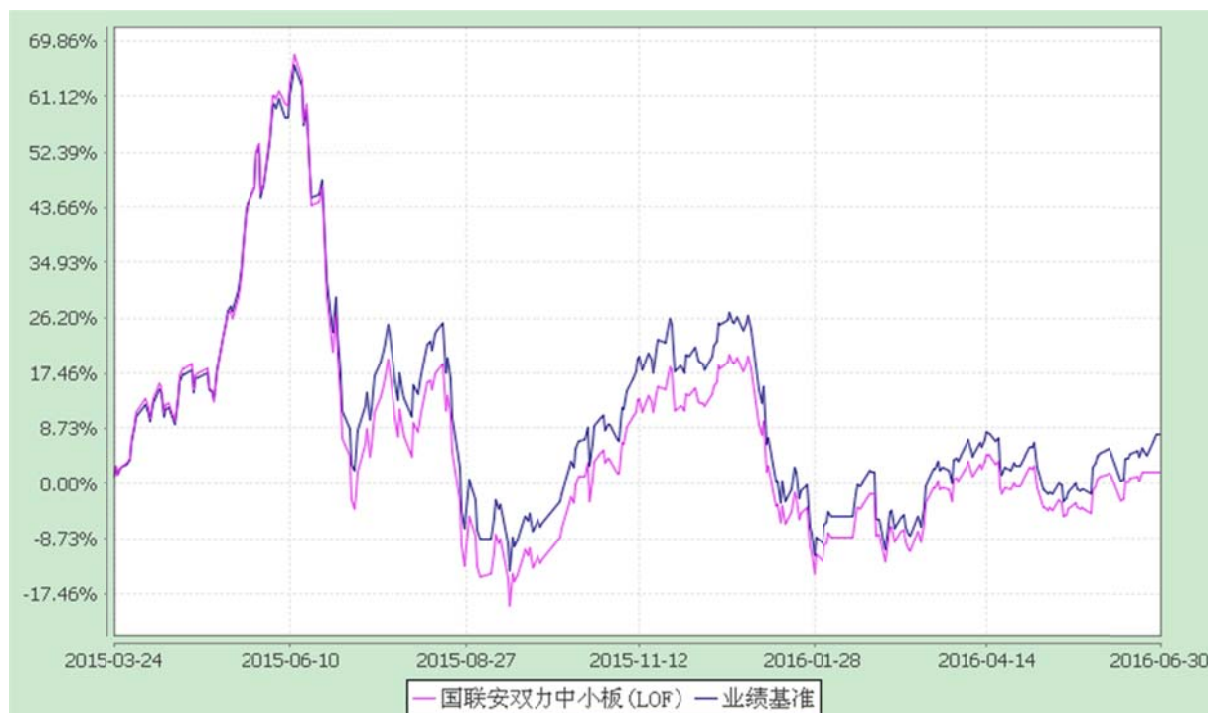
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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2016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，公司共管理三十一只开放式基金。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		
冒浩	本基金基金经理、兼任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理	2015-05-29	-	6年（自2010年起）	冒浩，英国帝国理工大学硕士研究生毕业，2009年加入国联安基金管理有限公司，从事量化投资相关工作。先后担任基金经理助理、基金经理。2015年5月起担任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。2015年5月起兼任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

在报告期内，本基金采取市值优先和行业分层的抽样方法来复制中小板综合指数。在处理日常的申购赎回、新增成份股、流通股本变动、成份股长期停牌等事件过程中，综合考虑交易成本、个股和行业权重偏离等因素进行组合调整，将本基金的跟踪误差控制在合理水平。

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 1.038 元，本报告期份额净值增长率为-13.87%，同期业绩比较基准收益率为-13.39%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.16%，符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35% 的限制；年化跟踪误差为 4.59%，超过基金合同约定的年化跟踪误差不超过 4.0% 的限制，主要系部分成份股长期停牌导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整，同时遭遇大额申购赎回造成净值波动所致。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年二季度，从宏观面来看，经济出现回调迹象，房地产销售触顶，带动地产投资增速从 7.2% 略降到 7%。全年来看，考虑到政府稳增长、房地产投资惯性以及工业品低库存的支撑，总需求回落并不会明显下降，预计房地产投资增长率稳定在 5% 左右，工业品价格跌幅继续收敛，PPI 预计在年底收敛到 0 附近。从市场来看，目前上证估值合理，考虑到今年经济整体平稳，供给侧改革持续推进，美联储加息进程缓慢，以及市场已消化了大部分风险，预计指数在 2700 点左右有很强的支撑，对应 PE 估值在 11-12 倍之间（相当于 2012-2013 年估值，即上一库存周期上升段的估值）。从去年高点 5178 点的几轮调整已经较大程度挤压了中小创的估值泡沫，同时优质中小市值公司继续肩负经济转型重任的使命也不会改变，因此优秀的中小公司也将继续享受政策红利，为投资人带来良好的收益。

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，本基金对本报告期内利润分配情况如下，符合本基金基金合同的相关规定。

本基金以截止至 2016 年 6 月 21 日的可供分配利润为基准，于 2016 年 6 月 30 日（场外）和 2016 年 7 月 1 日（场内）实施分红，向截止至 2016 年 6 月 28 日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额 7.2000 元派发红利。共发放红利 1,169,108,879.21 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

2015 年 6 月 18 日-2016 年 6 月 22 日本基金资产净值低于 5000 万元。

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，本基金实施利润分配的金额为 1,169,108,879.21 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(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	1,665,220,084.70	3,188,795.19
结算备付金		61,208.64	17,731.87
存出保证金		4,544.96	12,473.07
交易性金融资产	6.4.7.2	22,000,695.44	21,511,754.38
其中：股票投资		22,000,695.44	21,511,754.38
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	342,044.18	631.05
应收股利		-	-
应收申购款		62,374.37	1,587.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,687,690,952.29	24,732,972.84
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		-	-
卖出回购金融资产款	6.4.7.3	-	-
应付证券清算款		-	89.03
应付赎回款		287,769,904.34	65,279.46

应付管理人报酬		331,289.48	15,728.37
应付托管费		97,178.24	4,613.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		18,986.87	9,604.57
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	1,206,418.78	96,469.83
负债合计		289,423,777.71	191,784.92
所有者权益：		-	-
实收基金		1,260,733,001.81	11,245,301.70
未分配利润	6.4.7.9	137,534,172.77	13,295,886.22
所有者权益合计	6.4.7.10	1,398,267,174.58	24,541,187.92
负债和所有者权益总计		1,687,690,952.29	24,732,972.84

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.038 元，基金份额总额 1,347,601,148.07 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：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 3 月 24 日（基 金合同生效日）至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-1,657,379.44	5,117,094.08
1.利息收入		352,135.72	7,222.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	352,135.72	7,222.27
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）		432,029.73	6,165,317.88
其中：股票投资收益	6.4.7.12	304,470.13	6,037,263.39
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	127,559.60	128,054.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.16	-2,809,157.45	-1,097,758.58

填列)			
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	367,612.56	42,312.51
减: 二、费用		720,364.85	227,466.39
1. 管理人报酬		401,833.97	76,449.04
2. 托管费		117,871.26	22,425.10
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	43,902.39	41,949.40
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	156,757.23	86,642.85
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,377,744.29	4,889,627.69
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,377,744.29	4,889,627.69

注: 本基金于 2015 年 3 月 24 日转型。上年度可比期间为 2015 年 3 月 24 日(基金转型后首日)至 2015 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 国联安双力中小板综指证券投资基金(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)	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

项目	上年度可比期间		
	2015年3月24日(基金合同生效日)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)	17,150,609.79	14,520,270.99	31,670,880.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,889,627.69	4,889,627.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-755,969.48	2,612,979.50	1,857,010.02
其中：1.基金申购款	13,329,113.98	23,560,216.11	36,889,330.09
2.基金赎回款	-14,085,083.46	-20,947,236.61	-35,032,320.07
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)	16,394,640.31	22,022,878.18	38,417,518.49

注：本基金于2015年3月24日转型。上年度可比期间为2015年3月24日(基金转型后首日)至2015年6月30日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

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 2016 年 6 月

30日的财务状况、自2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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》、财税字[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[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》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) 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。
- (d) 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，暂减按25%计入应纳税所得额，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
- (e) 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。
- (f) 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 2016年6月30日
活期存款	1,665,220,084.70
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,665,220,084.70

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	18,457,312.69	22,000,695.44	3,543,382.75
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	18,457,312.69	22,000,695.44	3,543,382.75

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 2016年6月30日
应收活期存款利息	228,334.34
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	27.50
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	113,680.34
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	2.00
合计	342,044.18

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 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	18,986.87
银行间市场应付交易费用	-
合计	18,986.87

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	1,084,557.74
指数使用费	9,621.12
审计费用	97,323.20
预提费用	14,916.72
合计	1,206,418.78

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	12,020,101.89	11,245,301.70
本期申购	1,617,411,207.93	1,513,071,691.09
本期赎回(以“-”号填列)	-281,830,161.75	-263,583,990.98
本期末	1,347,601,148.07	1,260,733,001.81

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	11,345,161.83	1,950,724.39	13,295,886.22
本期利润	431,413.16	-2,809,157.45	-2,377,744.29
本期基金份额交易产生的变动数	1,472,429,041.31	-176,704,131.26	1,295,724,910.05
其中：基金申购款	1,540,316,530.77	-213,984,845.55	1,326,331,685.22
基金赎回款	-67,887,489.46	37,280,714.29	-30,606,775.17
本期已分配利润	-1,169,108,879.21	-	-1,169,108,879.21
本期末	315,096,737.09	-177,562,564.32	137,534,172.77

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	238,217.54
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	192.85	
其他	113,725.33	
合计	352,135.72	

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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	卖出股票成交总额	13,636,220.64
减：卖出股票成本总额	13,331,750.51	
买卖股票差价收入	304,470.13	

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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	127,559.60
基金投资产生的股利收益	-
合计	127,559.60

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-2,809,157.45
——股票投资	-2,809,157.45
——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	-2,809,157.45

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	367,612.56
合计	367,612.56

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 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	43,902.39
银行间市场交易费用	-
合计	43,902.39

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	32,323.20
信息披露费	14,916.72
银行划款费用	1,070.00
其他	50.00
指数使用费	108,397.31
合计	156,757.23

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，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，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，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，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，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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年3月24日(基金合同生 效日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	401,833.97	76,449.04
其中：支付销售机构的客户维护费	46,145.59	21,901.72

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年3月24日(基金合同生 效日)至2015年6月30日
----	--------------------------------	---

当期发生的基金应支付的托管费	117,871.26	22,425.10
----------------	------------	-----------

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，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，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

本期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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效日）至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	1,665,220,084.70	238,217.54	3,494,242.03	7,185.82

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

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，本基金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，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016-06-28	2016-06-29	2016-06-28	7.200	1,167,625,941.14	1,482,938.07	1,169,108,879.21	-
合计				7.200	1,167,625,941.14	1,482,938.07	1,169,108,879.21	-

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

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
002012	凯恩股份	2016-01-19	重大事项	8.71	2016-07-18	8.80	4,088.00	22,647.52	35,606.48	-
002052	同洲电子	2016-01-12	重大事项	10.03	-	-	2,041.00	11,855.58	20,471.23	-
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项	25.10	2016-07-04	22.59	4,700.00	98,413.85	117,970.00	-
002071	长城影视	2016-06-16	重大事项	13.64	-	-	1,951.00	13,482.67	26,611.64	-
002089	新海宜	2016-01-08	重大事项	16.88	2016-07-18	18.55	2,861.00	49,870.58	48,293.68	-
002127	南极电商	2016-05-16	重大事项	9.63	-	-	6,000.00	46,500.00	57,780.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.29	-	-	7,948.00	105,695.21	65,888.92	-
002134	天津普林	2016-05-09	重大事项	14.50	2016-07-29	13.26	1,300.00	14,001.00	18,850.00	-
002175	东方网络	2016-05-09	重大事项	46.09	-	-	700.00	30,891.00	32,263.00	-

002190	成飞集成	2016-04-21	重大事项	35.44	2016-07-12	38.98	1,161.00	34,714.37	41,145.84	-
002266	浙富控股	2016-05-25	重大事项	5.35	-	-	4,669.00	30,501.41	24,979.15	-
002280	联络互动	2016-04-25	重大事项	19.71	-	-	2,255.00	15,035.67	44,446.05	-
002283	天润曲轴	2016-03-23	重大事项	17.15	-	-	1,745.00	11,863.62	29,926.75	-
002313	日海通讯	2016-06-20	重大事项	13.59	2016-07-04	14.95	2,300.00	30,636.00	31,257.00	-
002314	南山控股	2016-03-07	重大事项	6.83	2016-07-19	7.51	4,482.00	17,718.14	30,612.06	-
002316	键桥通讯	2016-05-25	重大事项	12.41	-	-	2,276.00	16,539.48	28,245.16	-
002331	皖通科技	2016-04-18	重大事项	16.54	2016-07-11	15.31	2,088.00	37,157.62	34,535.52	-
002347	泰尔重工	2016-04-05	重大事项	19.45	2016-07-18	21.40	1,148.00	9,841.66	22,328.60	-
002355	兴民钢圈	2016-05-12	重大事项	19.35	-	-	2,100.00	39,249.00	40,635.00	-
002389	南洋科技	2016-02-03	重大事项	12.95	-	-	2,600.00	19,732.19	33,670.00	-
002432	九安医疗	2016-06-20	重大事项	18.14	2016-07-13	19.95	2,191.00	45,535.81	39,744.74	-
002445	中南文化	2016-06-14	重大事项	22.99	-	-	1,814.00	34,020.11	41,703.86	-
002452	长高集团	2016-06-14	重大事项	12.02	2016-07-12	10.82	1,500.00	17,685.00	18,030.00	-
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项	12.44	-	-	21,774.00	255,337.54	270,868.56	-
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大事项	12.66	-	-	3,168.00	42,962.60	40,106.88	-
002567	唐人神	2016-05-16	重大事项	13.98	2016-07-29	13.23	3,277.00	27,250.10	45,812.46	-
002574	明牌珠宝	2016-06-27	重大事项	13.04	-	-	3,196.00	29,705.71	41,675.84	-
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事项	14.45	2016-07-28	14.00	1,600.00	14,208.00	23,120.00	-
002591	恒大高新	2016-04-15	重大事项	17.78	-	-	1,100.00	14,850.00	19,558.00	-
002617	露笑科技	2016-05-09	重大事项	15.60	-	-	2,781.00	7,226.16	43,383.60	-
002630	华西能源	2016-04-25	重大事项	11.06	-	-	3,294.00	14,385.17	36,431.64	-

002631	德尔未来	2016-06-29	重大事项	26.60	-	-	1,128.00	19,534.62	30,004.80	-
002647	宏磊股份	2015-11-17	重大事项	23.84	2016-08-08	26.00	1,032.00	7,922.66	24,602.88	-
002654	万润科技	2016-05-09	重大事项	15.57	-	-	2,100.00	24,920.00	32,697.00	-
002663	普邦园林	2016-04-28	重大事项	7.36	-	-	6,600.00	44,346.51	48,576.00	-
002682	龙洲股份	2016-04-06	重大事项	12.69	2016-07-20	13.96	1,500.00	16,500.00	19,035.00	-
002685	华东重机	2016-05-23	重大事项	9.03	-	-	5,628.00	51,580.56	50,820.84	-

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

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股票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。

6.4.13.2.2 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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可用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 2016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	1,665,220,084.70	-	-	-	-	-	-	-	-	1,665,220,084.70
结算备付金	61,208.64	-	-	-	-	-	-	-	-	61,208.64
存出保证金	4,544.96	-	-	-	-	-	-	-	-	4,544.96
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	22,000,695.44	22,000,695.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	342,044.18	342,044.18
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	62,374.37	62,374.37
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,665,285,838.30	-	-	-	-	-	-	-	22,405,113.99	1,687,690,952.29
负债										
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	287,769,904.34	287,769,904.34

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	-	-	-	331,289.48	331,289.48
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	97,178.24	97,178.24
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	18,986.87	18,986.87
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,206,418.78	1,206,418.78
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	289,423.77	289,423.77
利率敏感度缺口	1,665,285,838.30	-	-	-	-	-	-	-	-	-267,018,663.72	1,398,267,174.58
上年度末 2015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	3,494,242.03	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,494,242.03
结算备付金	14,573.17	-	-	-	-	-	-	-	-	-	14,573.17
存出保证金	4,096.58	-	-	-	-	-	-	-	-	-	4,096.58
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	35,851,350.44	35,851,350.44
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	787,445.59	787,445.59
应收利息	-	-	-	-	-	-	-	-	-	675.81	675.81
应收股利	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	32,131.07	32,131.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	32,566.42	32,566.42
资产总计	3,512,911.78	-	-	-	-	-	-	-	-	36,704,169.33	40,217,081.11
负债											
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,685,452.86	1,685,452.86
应付管理人报	-	-	-	-	-	-	-	-	-	30,912.33	30,912.33

酬											3
应付托管费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	8,990.14	8,990.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	-	-	-	24,084.38	24,084.38
其他负债	-	-	-	-	-	-	-	-	-	50,122.91	50,122.91
负债总计	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,799,562.62	1,799,562.62
利率敏感度缺口	3,512,911.78	-	-	-	-	-	-	-	-	34,904,606.71	38,417,518.49

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 1.57%，无债券投资和衍生金融资产。于 2016 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 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	22,000,695.44	1.57	21,511,754.38	87.66
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	22,000,695.44	1.57	21,511,754.38	87.66

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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加 65,465,764.96	增加 1,298,439.10
	业绩比较基准下降5%	减少 65,465,764.96	减少 1,298,439.10

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	22,000,695.44	1.30
	其中:股票	22,000,695.44	1.30
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	1,665,281,293.34	98.67
7	其他各项资产	408,963.51	0.02
8	合计	1,687,690,952.29	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	269,592.19	0.02
B	采矿业	145,900.52	0.01
C	制造业	16,364,970.59	1.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,940.65	0.01
E	建筑业	698,932.83	0.05
F	批发和零售业	735,574.03	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	132,212.77	0.01
H	住宿和餐饮业	77,615.58	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,757,600.07	0.13
J	金融业	710,050.03	0.05
K	房地产业	315,717.15	0.02
L	租赁和商务服务业	379,955.01	0.03
M	科学研究和技术服务业	62,512.38	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	244,121.64	0.02
S	综合	-	-
	合计	22,000,695.44	1.57

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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

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	002176	江特电机	28,653	441,256.20	0.03
2	002454	松芝股份	21,908	398,287.44	0.03
3	002095	生意宝	6,890	385,771.10	0.03
4	002415	海康威视	17,478	375,077.88	0.03
5	002304	洋河股份	4,562	328,099.04	0.02
6	002252	上海莱士	7,500	282,600.00	0.02
7	002465	海格通信	21,774	270,868.56	0.02
8	002223	鱼跃医疗	8,000	253,760.00	0.02
9	002736	国信证券	14,165	244,346.25	0.02
10	002230	科大讯飞	7,057	231,822.45	0.02
11	002024	苏宁云商	18,700	203,082.00	0.01
12	002450	康得新	10,419	178,164.90	0.01
13	002142	宁波银行	11,996	177,300.88	0.01
14	002594	比亚迪	2,754	168,021.54	0.01
15	002500	山西证券	9,350	154,836.00	0.01
16	002241	歌尔股份	4,736	135,828.48	0.01
17	002673	西部证券	5,165	133,566.90	0.01
18	002475	立讯精密	6,513	127,980.45	0.01
19	002075	沙钢股份	8,380	120,001.60	0.01
20	002065	东华软件	4,700	117,970.00	0.01

21	002739	万达院线	1,400	111,860.00	0.01
22	002202	金风科技	7,321	110,766.73	0.01
23	002183	怡亚通	7,600	108,832.00	0.01
24	002049	紫光国芯	2,200	96,690.00	0.01
25	002179	中航光电	2,191	94,914.12	0.01
26	002187	广百股份	7,655	94,309.60	0.01
27	002493	荣盛石化	7,682	93,105.84	0.01
28	002085	万丰奥威	5,410	92,997.90	0.01
29	002311	海大集团	5,681	89,589.37	0.01
30	002618	丹邦科技	2,582	87,503.98	0.01
31	002405	四维图新	3,537	87,010.20	0.01
32	002081	金螳螂	8,476	84,929.52	0.01
33	002537	海立美达	2,752	83,660.80	0.01
34	002236	大华股份	6,372	83,473.20	0.01
35	002007	华兰生物	2,649	83,178.60	0.01
36	002456	欧菲光	2,808	82,836.00	0.01
37	002508	老板电器	2,250	82,732.50	0.01
38	002008	大族激光	3,618	82,635.12	0.01
39	002299	圣农发展	3,170	82,103.00	0.01
40	002470	金正大	10,048	80,886.40	0.01
41	002219	恒康医疗	7,212	79,692.60	0.01
42	002018	华信国际	8,372	79,534.00	0.01
43	002186	全聚德	3,962	77,615.58	0.01
44	002031	巨轮智能	17,034	76,993.68	0.01
45	002557	洽洽食品	4,036	75,231.04	0.01
46	002146	荣盛发展	11,183	75,149.76	0.01
47	002563	森马服饰	6,886	74,575.38	0.01
48	002407	多氟多	1,750	74,532.50	0.01
49	002152	广电运通	4,498	73,947.12	0.01
50	002491	通鼎互联	4,248	72,470.88	0.01
51	002444	巨星科技	3,506	71,241.92	0.01
52	002051	中工国际	3,592	70,654.64	0.01
53	002399	海普瑞	4,041	70,555.86	0.01
54	002001	新和成	3,309	69,919.17	0.01
55	002292	奥飞娱乐	2,312	69,244.40	0.00
56	002461	珠江啤酒	5,948	69,115.76	0.00
57	002544	杰赛科技	2,126	68,180.82	0.00
58	002343	慈文传媒	1,400	67,900.00	0.00
59	002650	加加食品	9,441	67,125.51	0.00
60	002340	格林美	7,600	66,652.00	0.00
61	002256	彩虹精化	2,012	65,993.60	0.00
62	002129	中环股份	7,948	65,888.92	0.00
63	002474	榕基软件	3,485	65,866.50	0.00
64	002038	双鹭药业	2,156	65,068.08	0.00

65	002385	大北农	8,016	64,608.96	0.00
66	002030	达安基因	2,307	64,134.60	0.00
67	002689	远大智能	8,105	62,813.75	0.00
68	002416	爱施德	3,100	61,566.00	0.00
69	002108	沧州明珠	2,371	61,408.90	0.00
70	002376	新北洋	4,592	61,349.12	0.00
71	002520	日发精机	4,134	61,017.84	0.00
72	002511	中顺洁柔	3,551	60,473.53	0.00
73	002437	誉衡药业	6,900	60,030.00	0.00
74	002303	美盈森	4,852	59,631.08	0.00
75	002426	胜利精密	6,000	59,100.00	0.00
76	002276	万马股份	2,981	59,053.61	0.00
77	002597	金禾实业	4,322	58,217.34	0.00
78	002127	南极电商	6,000	57,780.00	0.00
79	002032	苏泊尔	1,655	57,014.75	0.00
80	002506	协鑫集成	8,200	56,744.00	0.00
81	002097	山河智能	5,476	56,348.04	0.00
82	002384	东山精密	2,833	56,263.38	0.00
83	002367	康力电梯	3,642	56,086.80	0.00
84	002572	索菲亚	1,000	56,020.00	0.00
85	002589	瑞康医药	1,824	56,015.04	0.00
86	002155	湖南黄金	4,253	56,012.01	0.00
87	002638	勤上光电	2,599	55,800.53	0.00
88	002080	中材科技	2,774	55,701.92	0.00
89	002210	飞马国际	2,730	55,528.20	0.00
90	002287	奇正藏药	1,451	54,963.88	0.00
91	002371	七星电子	1,300	54,366.00	0.00
92	002050	三花股份	5,574	53,789.10	0.00
93	002284	亚太股份	2,817	53,776.53	0.00
94	002177	御银股份	5,451	53,692.35	0.00
95	002077	大港股份	2,410	53,502.00	0.00
96	002138	顺络电子	2,950	53,483.50	0.00
97	002601	佰利联	3,783	52,772.85	0.00
98	002489	浙江永强	6,651	52,675.92	0.00
99	002400	省广股份	3,723	52,605.99	0.00
100	002676	顺威股份	2,132	52,404.56	0.00
101	002498	汉缆股份	11,740	50,951.60	0.00
102	002643	万润股份	1,000	50,880.00	0.00
103	002685	华东重机	5,628	50,820.84	0.00
104	002273	水晶光电	1,812	50,717.88	0.00
105	002427	尤夫股份	2,500	50,175.00	0.00
106	002244	滨江集团	7,456	49,955.20	0.00
107	002285	世联行	6,411	49,941.69	0.00
108	002226	江南化工	5,092	48,781.36	0.00

109	002603	以岭药业	3,065	48,764.15	0.00
110	002528	英飞拓	5,478	48,644.64	0.00
111	002663	普邦园林	6,600	48,576.00	0.00
112	002089	新海宜	2,861	48,293.68	0.00
113	002695	煌上煌	953	47,993.08	0.00
114	002353	杰瑞股份	2,485	47,910.80	0.00
115	002301	齐心集团	2,322	47,601.00	0.00
116	002556	辉隆股份	3,142	47,475.62	0.00
117	002056	横店东磁	2,766	47,022.00	0.00
118	002237	恒邦股份	3,635	46,818.80	0.00
119	002518	科士达	1,878	46,724.64	0.00
120	002510	天汽模	5,600	46,592.00	0.00
121	002268	卫士通	1,300	46,462.00	0.00
122	002294	信立泰	1,698	46,185.60	0.00
123	002191	劲嘉股份	3,984	46,174.56	0.00
124	002439	启明星辰	1,784	46,080.72	0.00
125	002232	启明信息	3,007	46,067.24	0.00
126	002635	安洁科技	1,200	46,056.00	0.00
127	002570	贝因美	3,600	46,044.00	0.00
128	002577	雷柏科技	900	45,945.00	0.00
129	002055	得润电子	1,500	45,930.00	0.00
130	002414	高德红外	1,700	45,849.00	0.00
131	002567	唐人神	3,277	45,812.46	0.00
132	002640	跨境通	2,600	45,812.00	0.00
133	002701	奥瑞金	5,141	45,395.03	0.00
134	002099	海翔药业	4,768	45,391.36	0.00
135	002436	兴森科技	1,988	45,306.52	0.00
136	002168	深圳惠程	3,209	45,182.72	0.00
137	002041	登海种业	2,905	45,143.70	0.00
138	002121	科陆电子	3,835	45,061.25	0.00
139	002153	石基信息	1,695	44,714.10	0.00
140	002053	云南盐化	1,573	44,657.47	0.00
141	002006	精功科技	3,298	44,621.94	0.00
142	002280	联络互动	2,255	44,446.05	0.00
143	002694	顾地科技	2,500	44,350.00	0.00
144	002410	广联达	3,100	44,330.00	0.00
145	002681	奋达科技	2,624	44,293.12	0.00
146	002335	科华恒盛	908	44,056.16	0.00
147	002609	捷顺科技	2,500	43,975.00	0.00
148	002047	宝鹰股份	4,392	43,920.00	0.00
149	002308	威创股份	2,656	43,638.08	0.00
150	002242	九阳股份	2,400	43,632.00	0.00
151	002310	东方园林	1,824	43,630.08	0.00
152	002429	兆驰股份	5,202	43,592.76	0.00

153	002035	华帝股份	1,779	43,549.92	0.00
154	002617	露笑科技	2,781	43,383.60	0.00
155	002079	苏州固锴	3,874	43,272.58	0.00
156	002221	东华能源	3,536	43,103.84	0.00
157	002646	青青稞酒	2,087	43,013.07	0.00
158	002093	国脉科技	3,453	42,851.73	0.00
159	002156	通富微电	3,008	42,412.80	0.00
160	002641	永高股份	5,137	42,328.88	0.00
161	002501	利源精制	3,874	41,839.20	0.00
162	002147	新光圆成	2,699	41,807.51	0.00
163	002445	中南文化	1,814	41,703.86	0.00
164	002574	明牌珠宝	3,196	41,675.84	0.00
165	002443	金洲管道	2,900	41,615.00	0.00
166	002195	二三四五	3,380	41,540.20	0.00
167	002678	珠江钢琴	3,382	41,497.14	0.00
168	002483	润邦股份	3,587	41,393.98	0.00
169	002224	三力士	1,785	41,322.75	0.00
170	002271	东方雨虹	2,398	41,317.54	0.00
171	002004	华邦健康	4,523	41,294.99	0.00
172	002622	永大集团	3,354	41,254.20	0.00
173	002540	亚太科技	4,730	41,245.60	0.00
174	002477	雏鹰农牧	6,900	41,193.00	0.00
175	002190	成飞集成	1,161	41,145.84	0.00
176	002267	陕天然气	3,908	41,034.00	0.00
177	002131	利欧股份	2,400	41,016.00	0.00
178	002355	兴民钢圈	2,100	40,635.00	0.00
179	002062	宏润建设	6,853	40,569.76	0.00
180	002185	华天科技	3,185	40,545.05	0.00
181	002104	恒宝股份	2,459	40,425.96	0.00
182	002279	久其软件	1,820	40,367.60	0.00
183	002665	首航节能	5,108	40,302.12	0.00
184	002375	亚厦股份	3,553	40,148.90	0.00
185	002492	恒基达鑫	3,168	40,106.88	0.00
186	002590	万安科技	1,286	40,033.18	0.00
187	002333	罗普斯金	4,084	39,778.16	0.00
188	002074	国轩高科	1,007	39,746.29	0.00
189	002432	九安医疗	2,191	39,744.74	0.00
190	002546	新联电子	3,237	39,717.99	0.00
191	002661	克明面业	2,400	39,384.00	0.00
192	002602	世纪华通	2,122	39,320.66	0.00
193	002228	合兴包装	7,064	39,275.84	0.00
194	002025	航天电器	1,588	39,207.72	0.00
195	002431	棕榈股份	3,407	39,180.50	0.00
196	002128	露天煤业	5,153	38,699.03	0.00

197	002503	搜于特	3,113	38,663.46	0.00
198	002550	千红制药	4,632	38,630.88	0.00
199	002281	光迅科技	600	38,520.00	0.00
200	002039	黔源电力	2,000	38,460.00	0.00
201	002462	嘉事堂	1,023	38,106.75	0.00
202	002048	宁波华翔	1,659	37,941.33	0.00
203	002107	沃华医药	2,369	37,904.00	0.00
204	002320	海峡股份	2,433	37,881.81	0.00
205	002208	合肥城建	1,945	37,771.90	0.00
206	002624	完美环球	1,000	37,750.00	0.00
207	002463	沪电股份	7,148	37,741.44	0.00
208	002362	汉王科技	1,372	37,716.28	0.00
209	002422	科伦药业	2,446	37,692.86	0.00
210	002396	星网锐捷	1,913	37,686.10	0.00
211	002203	海亮股份	4,849	37,676.73	0.00
212	002626	金达威	2,236	37,676.60	0.00
213	002649	博彦科技	950	37,591.50	0.00
214	002502	骅威文化	1,526	37,539.60	0.00
215	002372	伟星新材	2,608	37,450.88	0.00
216	002484	江海股份	2,445	37,286.25	0.00
217	002078	太阳纸业	7,581	36,995.28	0.00
218	002628	成都路桥	5,268	36,717.96	0.00
219	002428	云南锗业	2,134	36,662.12	0.00
220	002698	博实股份	1,900	36,594.00	0.00
221	002023	海特高新	2,110	36,566.30	0.00
222	002481	双塔食品	5,000	36,500.00	0.00
223	002630	华西能源	3,294	36,431.64	0.00
224	002488	金固股份	1,725	36,259.50	0.00
225	002170	芭田股份	4,289	36,199.16	0.00
226	002250	联化科技	2,527	36,186.64	0.00
227	002424	贵州百灵	2,100	36,120.00	0.00
228	002612	朗姿股份	1,442	35,949.06	0.00
229	002519	银河电子	1,600	35,872.00	0.00
230	002261	拓维信息	2,590	35,819.70	0.00
231	002269	美邦服饰	8,139	35,811.60	0.00
232	002364	中恒电气	1,300	35,659.00	0.00
233	002012	凯恩股份	4,088	35,606.48	0.00
234	002117	东港股份	1,131	35,581.26	0.00
235	002204	大连重工	8,794	35,527.76	0.00
236	002531	天顺风能	5,531	35,453.71	0.00
237	002100	天康生物	3,936	35,384.64	0.00
238	002151	北斗星通	1,050	35,343.00	0.00
239	002096	南岭民爆	2,369	35,298.10	0.00
240	002014	永新股份	2,207	35,201.65	0.00

241	002627	宜昌交运	1,663	35,189.08	0.00
242	002143	印纪传媒	1,500	35,145.00	0.00
243	002181	粤传媒	4,267	35,032.07	0.00
244	002344	海宁皮城	3,593	35,031.75	0.00
245	002154	报喜鸟	7,243	34,983.69	0.00
246	002433	太安堂	3,487	34,939.74	0.00
247	002394	联发股份	2,308	34,850.80	0.00
248	002359	齐星铁塔	1,400	34,790.00	0.00
249	002123	荣信股份	1,670	34,719.30	0.00
250	002318	久立特材	3,000	34,710.00	0.00
251	002171	楚江新材	2,009	34,615.07	0.00
252	002331	皖通科技	2,088	34,535.52	0.00
253	002539	新都化工	2,252	34,433.08	0.00
254	002468	艾迪西	1,200	34,344.00	0.00
255	002161	远望谷	2,300	34,247.00	0.00
256	002595	豪迈科技	1,600	34,192.00	0.00
257	002020	京新药业	2,764	34,190.68	0.00
258	002413	雷科防务	2,480	34,050.40	0.00
259	002178	延华智能	3,100	34,038.00	0.00
260	002092	中泰化学	4,013	33,949.98	0.00
261	002559	亚威股份	2,299	33,910.25	0.00
262	002419	天虹商场	2,825	33,787.00	0.00
263	002293	罗莱生活	2,465	33,770.50	0.00
264	002045	国光电器	2,362	33,729.36	0.00
265	002262	恩华药业	1,671	33,670.65	0.00
266	002389	南洋科技	2,600	33,670.00	0.00
267	002435	长江润发	1,869	33,623.31	0.00
268	002115	三维通信	2,919	33,539.31	0.00
269	002662	京威股份	2,215	33,468.65	0.00
270	002482	广田集团	4,415	33,465.70	0.00
271	002083	孚日股份	5,282	33,276.60	0.00
272	002068	黑猫股份	4,248	33,134.40	0.00
273	002534	杭锅股份	3,105	33,068.25	0.00
274	002449	国星光电	2,491	33,055.57	0.00
275	002548	金新农	1,881	33,030.36	0.00
276	002091	江苏国泰	2,083	33,015.55	0.00
277	002402	和而泰	1,220	33,001.00	0.00
278	002425	凯撒股份	1,500	33,000.00	0.00
279	002657	中科金财	600	32,964.00	0.00
280	002206	海利得	1,922	32,923.86	0.00
281	002476	宝莫股份	4,059	32,837.31	0.00
282	002180	艾派克	1,150	32,809.50	0.00
283	002302	西部建设	4,532	32,721.04	0.00
284	002654	万润科技	2,100	32,697.00	0.00

285	002596	海南瑞泽	1,144	32,546.80	0.00
286	002240	威华股份	2,429	32,451.44	0.00
287	002275	桂林三金	1,749	32,286.54	0.00
288	002175	东方网络	700	32,263.00	0.00
289	002369	卓翼科技	2,867	32,253.75	0.00
290	002418	康盛股份	3,051	32,218.56	0.00
291	002312	三泰控股	1,700	32,215.00	0.00
292	002216	三全食品	3,742	32,181.20	0.00
293	002565	上海绿新	4,319	32,003.79	0.00
294	002174	游族网络	1,000	32,000.00	0.00
295	002148	北纬通信	1,600	31,920.00	0.00
296	002533	金杯电工	2,369	31,815.67	0.00
297	002366	台海核电	596	31,772.76	0.00
298	002122	天马股份	5,099	31,715.78	0.00
299	002135	东南网架	4,071	31,631.67	0.00
300	002106	莱宝高科	2,658	31,577.04	0.00
301	002620	瑞和股份	816	31,464.96	0.00
302	002029	七匹狼	3,086	31,322.90	0.00
303	002313	日海通讯	2,300	31,257.00	0.00
304	002064	华峰氨纶	6,510	31,248.00	0.00
305	002535	林州重机	3,851	31,116.08	0.00
306	002485	希努尔	1,925	31,108.00	0.00
307	002642	荣之联	1,180	31,045.80	0.00
308	002675	东诚药业	667	31,035.51	0.00
309	002003	伟星股份	1,977	30,900.51	0.00
310	002625	龙生股份	700	30,786.00	0.00
311	002019	亿帆鑫富	2,000	30,760.00	0.00
312	002588	史丹利	2,480	30,628.00	0.00
313	002523	天桥起重	5,253	30,624.99	0.00
314	002314	南山控股	4,482	30,612.06	0.00
315	002217	合力泰	2,000	30,600.00	0.00
316	002010	传化股份	1,544	30,555.76	0.00
317	002430	杭氧股份	3,284	30,541.20	0.00
318	002036	联创电子	1,300	30,433.00	0.00
319	002060	粤水电	4,429	30,427.23	0.00
320	002348	高乐股份	4,600	30,222.00	0.00
321	002086	东方海洋	3,448	30,170.00	0.00
322	002141	蓉胜超微	999	30,169.80	0.00
323	002564	天沃科技	3,918	30,168.60	0.00
324	002218	拓日新能	2,954	30,130.80	0.00
325	002382	蓝帆医疗	2,672	30,033.28	0.00
326	002631	德尔未来	1,128	30,004.80	0.00
327	002283	天润曲轴	1,745	29,926.75	0.00
328	002377	国创高新	3,366	29,890.08	0.00

329	002209	达意隆	1,300	29,874.00	0.00
330	002305	南国置业	5,312	29,853.44	0.00
331	002011	盾安环境	2,644	29,824.32	0.00
332	002408	齐翔腾达	5,416	29,733.84	0.00
333	002459	天业通联	1,800	29,628.00	0.00
334	002254	泰和新材	2,156	29,580.32	0.00
335	002370	亚太药业	1,000	29,500.00	0.00
336	002022	科华生物	1,382	29,450.42	0.00
337	002332	仙琚制药	2,628	29,433.60	0.00
338	002309	中利科技	1,642	29,408.22	0.00
339	002543	万和电气	1,568	28,992.32	0.00
340	002521	齐峰新材	2,534	28,988.96	0.00
341	002140	东华科技	1,893	28,887.18	0.00
342	002378	章源钨业	2,758	28,821.10	0.00
343	002527	新时达	1,824	28,819.20	0.00
344	002277	友阿股份	2,493	28,719.36	0.00
345	002472	双环传动	1,179	28,673.28	0.00
346	002063	远光软件	1,852	28,613.40	0.00
347	002317	众生药业	2,378	28,512.22	0.00
348	002398	建研集团	2,167	28,474.38	0.00
349	002693	双成药业	3,000	28,380.00	0.00
350	002073	软控股份	2,355	28,377.75	0.00
351	002118	紫鑫药业	1,927	28,326.90	0.00
352	002471	中超控股	4,600	28,290.00	0.00
353	002316	键桥通讯	2,276	28,245.16	0.00
354	002182	云海金属	1,418	28,218.20	0.00
355	002440	闰土股份	1,893	28,111.05	0.00
356	002629	仁智油服	2,319	28,106.28	0.00
357	002328	新朋股份	2,811	28,053.78	0.00
358	002356	赫美集团	1,102	27,924.68	0.00
359	002522	浙江众成	1,488	27,900.00	0.00
360	002581	未名医药	1,022	27,849.50	0.00
361	002042	华孚色纺	2,690	27,814.60	0.00
362	002167	东方锆业	2,537	27,780.15	0.00
363	002584	西陇科学	2,085	27,751.35	0.00
364	002165	红宝丽	2,966	27,702.44	0.00
365	002600	江粉磁材	2,254	27,228.32	0.00
366	002417	三元达	1,786	27,200.78	0.00
367	002386	天原集团	3,797	27,110.58	0.00
368	002124	天邦股份	2,543	27,082.95	0.00
369	002201	九鼎新材	1,900	27,037.00	0.00
370	002325	洪涛股份	2,933	26,954.27	0.00
371	002339	积成电子	1,465	26,721.60	0.00
372	002071	长城影视	1,951	26,611.64	0.00

373	002479	富春环保	2,355	26,446.65	0.00
374	002238	天威视讯	1,824	26,393.28	0.00
375	002392	北京利尔	5,318	26,270.92	0.00
376	002069	*ST 獐岛	3,093	26,135.85	0.00
377	002363	隆基机械	2,000	26,040.00	0.00
378	002251	步步高	2,005	26,004.85	0.00
379	002605	姚记扑克	1,593	25,981.83	0.00
380	002674	兴业科技	1,681	25,769.73	0.00
381	002345	潮宏基	2,634	25,760.52	0.00
382	002578	闽发铝业	2,697	25,432.71	0.00
383	002494	华斯股份	1,646	25,430.70	0.00
384	002082	栋梁新材	1,600	25,408.00	0.00
385	002037	久联发展	1,563	25,289.34	0.00
386	002054	德美化工	2,331	25,244.73	0.00
387	002266	浙富控股	4,669	24,979.15	0.00
388	002087	新野纺织	3,155	24,892.95	0.00
389	002013	中航机电	1,846	24,884.08	0.00
390	002231	奥维通信	1,600	24,736.00	0.00
391	002647	宏磊股份	1,032	24,602.88	0.00
392	002441	众业达	1,518	24,576.42	0.00
393	002298	中电鑫龙	1,488	24,552.00	0.00
394	002321	华英农业	2,605	24,539.10	0.00
395	002420	毅昌股份	2,800	24,360.00	0.00
396	002668	奥马电器	400	24,348.00	0.00
397	002220	天宝股份	2,292	24,341.04	0.00
398	002406	远东传动	2,836	24,304.52	0.00
399	002374	丽鹏股份	3,520	24,112.00	0.00
400	002404	嘉欣丝绸	3,038	23,969.82	0.00
401	002667	鞍重股份	786	23,965.14	0.00
402	002393	力生制药	631	23,763.46	0.00
403	002211	宏达新材	1,999	23,708.14	0.00
404	002233	塔牌集团	2,932	23,543.96	0.00
405	002184	海得控制	894	23,521.14	0.00
406	002614	蒙发利	1,939	23,287.39	0.00
407	002587	奥拓电子	1,600	23,120.00	0.00
408	002554	惠博普	3,206	23,083.20	0.00
409	002516	旷达科技	3,800	22,914.00	0.00
410	002215	诺普信	2,200	22,748.00	0.00
411	002451	摩恩电气	1,815	22,542.30	0.00
412	002360	同德化工	1,901	22,526.85	0.00
413	002593	日上集团	2,946	22,448.52	0.00
414	002347	泰尔重工	1,148	22,328.60	0.00
415	002005	德豪润达	3,711	21,932.01	0.00
416	002139	拓邦股份	1,483	21,444.18	0.00

417	002478	常宝股份	1,900	21,356.00	0.00
418	002466	天齐锂业	500	21,345.00	0.00
419	002327	富安娜	2,482	21,121.82	0.00
420	002636	金安国纪	1,268	20,795.20	0.00
421	002495	佳隆股份	2,700	20,520.00	0.00
422	002545	东方铁塔	2,295	20,471.40	0.00
423	002052	同洲电子	2,041	20,471.23	0.00
424	002696	百洋股份	1,061	20,307.54	0.00
425	002350	北京科锐	1,000	20,200.00	0.00
426	002455	百川股份	2,040	20,114.40	0.00
427	002656	摩登大道	1,440	20,088.00	0.00
428	002504	弘高创意	822	19,892.40	0.00
429	002028	思源电气	1,806	19,775.70	0.00
430	002591	恒大高新	1,100	19,558.00	0.00
431	002016	世荣兆业	2,366	19,543.16	0.00
432	002255	海陆重工	2,222	19,131.42	0.00
433	002682	龙洲股份	1,500	19,035.00	0.00
434	002134	天津普林	1,300	18,850.00	0.00
435	002300	太阳电缆	1,930	18,778.90	0.00
436	002457	青龙管业	1,800	18,486.00	0.00
437	002452	长高集团	1,500	18,030.00	0.00
438	002110	三钢闽光	2,900	17,516.00	0.00
439	002307	北新路桥	2,200	17,270.00	0.00
440	002541	鸿路钢构	1,000	17,230.00	0.00
441	002391	长青股份	1,200	17,160.00	0.00
442	002088	鲁阳节能	1,100	17,116.00	0.00
443	002381	双箭股份	1,300	17,095.00	0.00
444	002193	山东如意	1,000	16,410.00	0.00
445	002692	远程电缆	1,980	16,236.00	0.00
446	002365	永安药业	886	16,134.06	0.00
447	002144	宏达高科	800	15,728.00	0.00
448	002295	精艺股份	985	15,464.50	0.00
449	002322	理工环科	771	14,602.74	0.00
450	002580	圣阳股份	753	14,276.88	0.00
451	002160	常铝股份	1,600	14,016.00	0.00
452	002536	西泵股份	900	13,581.00	0.00
453	002358	森源电气	464	7,159.52	0.00

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	002344	海宁皮城	2,386,450.00	9.72
2	002157	正邦科技	1,560,000.00	6.36
3	002477	雏鹰农牧	864,162.00	3.52
4	002465	海格通信	710,518.82	2.90
5	002236	大华股份	682,000.00	2.78
6	002673	西部证券	621,037.00	2.53
7	002664	信质电机	547,036.00	2.23
8	002466	天齐锂业	515,670.00	2.10
9	002736	国信证券	462,784.00	1.89
10	002534	杭锅股份	395,250.00	1.61
11	002183	怡亚通	393,468.00	1.60
12	002176	江特电机	379,000.00	1.54
13	002415	海康威视	359,028.00	1.46
14	002454	松芝股份	344,036.00	1.40
15	002223	鱼跃医疗	341,546.00	1.39
16	002663	普邦园林	335,000.00	1.37
17	002095	生意宝	330,000.00	1.34
18	002303	美盈森	317,563.00	1.29
19	002714	牧原股份	285,000.00	1.16
20	002252	上海莱士	280,800.00	1.14

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	002344	海宁皮城	2,553,000.00	10.40
2	002157	正邦科技	1,673,041.20	6.82
3	002477	雏鹰农牧	889,974.20	3.63
4	002236	大华股份	671,747.00	2.74
5	002673	西部证券	670,240.00	2.73
6	002664	信质电机	610,560.60	2.49
7	002465	海格通信	557,377.00	2.27
8	002466	天齐锂业	461,458.00	1.88
9	002534	杭锅股份	397,298.00	1.62
10	002183	怡亚通	396,975.36	1.62

11	002663	普邦园林	347,839.16	1.42
12	002736	国信证券	329,735.26	1.34
13	002415	海康威视	318,758.00	1.30
14	002303	美盈森	308,181.00	1.26
15	002714	牧原股份	273,563.00	1.11
16	002631	德尔未来	235,760.00	0.96
17	002045	国光电器	234,900.00	0.96
18	002245	澳洋顺昌	231,712.00	0.94
19	002358	森源电气	210,600.00	0.86
20	002048	宁波华翔	205,300.00	0.84

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	16,629,849.02
卖出股票的收入（成交）总额	13,636,220.64

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，本基金投资的前十名证券的发行主体中除国信证券外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

国信证券（002736）的发行主体国信证券股份有限公司于2015年11月26日发布公告称，其因未按照规定与客户签订业务合同的规定而被证监会立案调查。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	4,544.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	342,044.18
5	应收申购款	62,374.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	408,963.51

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	002465	海格通信	270,868.56	0.02	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
1,176	1,145,919.34	1,333,610,595.23	98.96%	13,990,552.84	1.04%

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	天安财产保险股份有限公司	569,151,394.42	42.23%
2	中国平安财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	455,321,001.71	33.79%

3	深圳市卓佳汇智创业投资有限公司	284,575,412.64	21.12%
4	上海新东吴优胜资产管理有限公司	21,627,205.46	1.60%
5	中银保险有限公司—传统保险产品	2,796,973.00	0.21%
6	郑淑女	932,651.00	0.07%
7	黄斌	626,559.96	0.05%
8	王慧娟	457,275.14	0.03%
9	李锦山	410,744.00	0.03%
10	郭连杰	383,885.41	0.03%

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

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 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	12,020,101.89
本报告期基金总申购份额	1,617,411,207.93
减：本报告期基金总赎回份额	281,830,161.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,347,601,148.07

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、2016年6月25日,基金管理人发布关于《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起刘轶先生担任我司督察长一职。公司总经理谭晓雨女士不再代为履行督察长职责。上述事项已经国联安基金管理有限公司第四届董事会第二十次会议审议通过。

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	30,266,069.66	100.00%	27,581.48	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
- 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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		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指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	公司网站	2016-01-04
2	国联安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-01-06
3	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万科 A 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	2016-01-06
4	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	公司网站	2016-01-07
5	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持海格通信、深信泰丰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	2016-01-09
6	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持天龙集团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	2016-01-13
7	基金所持冠昊生物(300238)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	2016-01-14
8	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持千方科技(002373)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	2016-01-15
9	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持拓维信息、康得新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	2016-01-16
10	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金四季报	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-01-20
11	国联安基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-28

	构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告		
12	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海佳豪、暴风科技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	2016-01-28
13	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宁波港等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	2016-01-29
14	国联安基金管理有限公司关于增加奕丰科技服务(深圳)前海有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、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	2016-01-29
15	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持创意信息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	2016-01-30
16	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万方发展、华信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	2016-01-30
17	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富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	2016-02-18
18	基金所持信威集团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	2016-02-18
19	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中茵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	2016-02-19
20	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加数米基金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、深交所、公司网站	2016-02-23
21	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持慈文传媒等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	2016-02-27
22	国联安基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-02-29
23	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持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	2016-03-02
24	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持金亚科技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	2016-03-04
25	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加北京乐融多源投资咨询有限公司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	2016-03-07
26	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浦发银行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	2016-03-05
27	国联安基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-03-11
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长安汽车等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	2016-03-19
29	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金 2015 年度报告摘要	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-28
30	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持	中国证券报、上证报、证	2016-03-31

	完美环球(002624)估值调整的公告	券时报、公司网站	
31	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持牧原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	2016-04-07
32	国联安基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-04-13
33	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金2016年度第一季度报告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-22
34	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-25
35	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持汇冠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	2016-05-06
36	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-06
37	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加了联泰资产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	2016-05-09
38	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持惠博普等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	2016-05-11
39	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持神州信息等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	2016-05-13
40	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持康耐特等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	2016-05-20
41	国联安基金管理有限公司关于增加北京微动利投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-06-03
42	国联安基金管理有限公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-06-03
43	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持黑牛食品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	2016-06-04
44	基金所持东方国信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	2016-06-15
45	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持格力电器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	2016-06-24
46	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)分红公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-24
47	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-25
48	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申购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	2016-06-30

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

11.3 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

二〇一六年八月二十六日