

# 国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：国都证券股份有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	11
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.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43

7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>49</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>49</b>
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国都创新驱动
场内简称	-
基金主代码	002020
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 28 日
基金管理人	国都证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	196,485,638.46 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险、保持良好流动性的前提下，积极主动管理，追求基金的长期稳健增值
投资策略	本基金以宏观分析为基础，结合各行业的演绎特征，确定阶段性重点行业，由行业研究团队加以重点覆盖。行业研究员重点对所覆盖的行业及个股的成长性及估值水平做出独立的判断和评级，精选优质个股作为构建组合的基础。一方面，基金管理人通过研究中国经济新常态下各行业在新形势下的转型和升级，结合宏观经济政策和导向，寻找中国当期阶段最受益的核心重点行业；另一方面，研究团队会对重点行业跟踪竞争格局的变化，把握产业演进和升级过程中，行业龙头盈利能力提升的投资机会
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*80%+中国债券总指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益风险水平的投资品种

### 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		国都证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李昭	吴荣
	联系电话	010-84183229	021-62699999
	电子邮箱	lizhao@guodu.com	011693@cib.com.cn
客户服务电话		400-818-8118	95561
传真		010-84183311	021-62535823
注册地址		北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	福建省福州市湖东路 154 号
办公地址		北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9、10 层	上海市静安区江宁路 168 号 20 楼
邮政编码		100007	200041
法定代表人		王少华	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a>
基金半年度报告备置地点	本基金管理人及本基金托管人住所

## 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	5,464,820.86
本期利润	9,110,442.14
加权平均基金份额本期利润	0.0333
本期加权平均净值利润率	3.30%
本期基金份额净值增长率	3.90%
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	4,517,644.23
期末可供分配基金份额利润	0.0230

期末基金资产净值	204,177,229.88
期末基金份额净值	1.039
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	3.90%

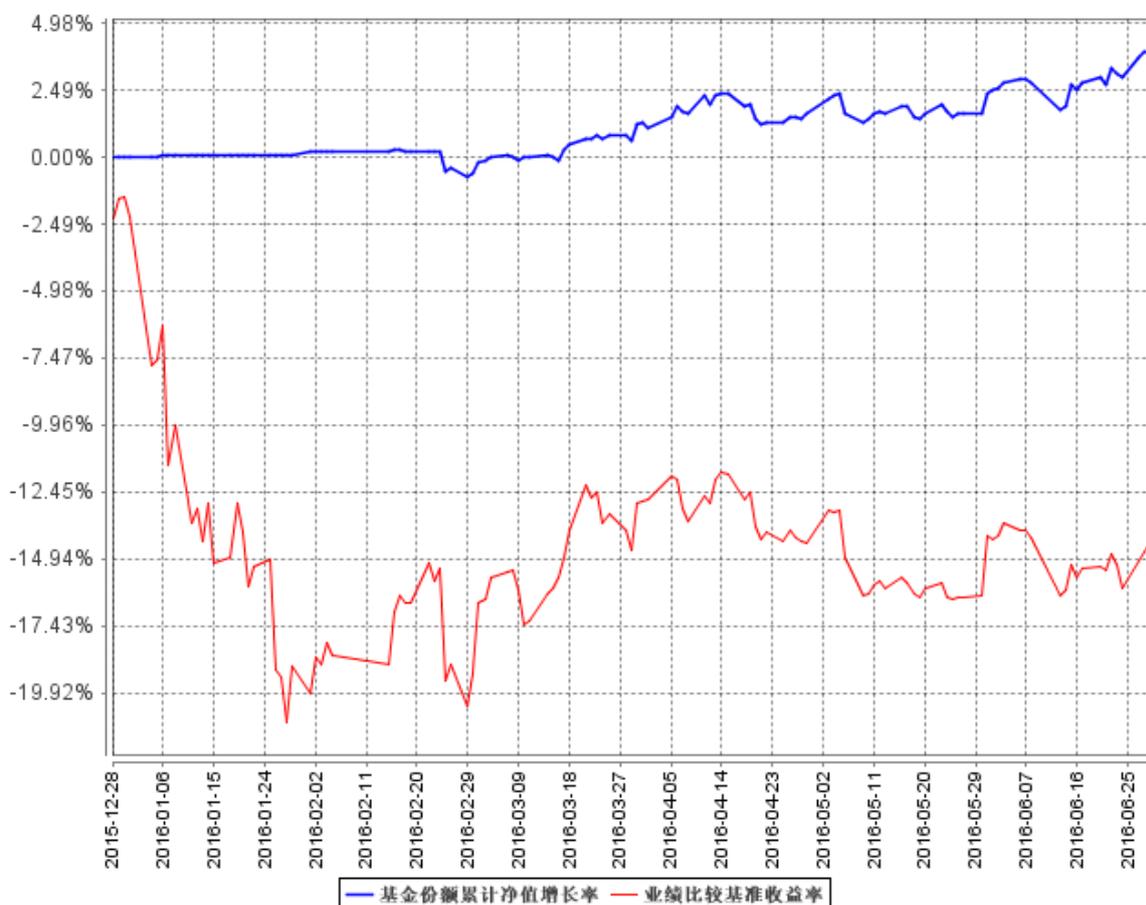
## 3.2 基金净值表现

### 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	1.46%	0.38%	-0.29%	0.79%	1.75%	-0.41%
过去三个月	2.57%	0.34%	-1.69%	0.81%	4.26%	-0.47%
过去六个月	3.90%	0.26%	-12.36%	1.48%	16.26%	-1.22%
自基金合同生效起至今	3.90%	0.26%	-14.30%	1.47%	18.20%	-1.21%

### 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

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



### 3.3 其他指标

## § 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

国都证券股份有限公司（以下简称“国都证券”）是由国都证券有限责任公司整体变更而来。国都证券有限责任公司是经中国证监会批准，在中诚信托有限责任公司和北京国际信托有限公司原有证券业务整合的基础上，吸收其他股东出资，于 2001 年 12 月 28 日成立的综合性证券公司，注册地为北京。2015 年 6 月 23 日公司组织形式由有限责任公司整体变更为股份有限公司，公司正式更名为“国都证券股份有限公司”，注册资本变更为 460000.0009 万元。2015 年 12 月 31 日

完成增资扩股，注册资本增至 530000.0009 万元。

截至 2015 年末，公司净资产 88.1 亿元。2014 年 8 月 19 日，经中国证监会批准，公司获准开展公募基金管理业务资格，截至 2016 年 6 月 30 日，本公司管理 1 只开放式证券投资基金——国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
游典宗	基金经理	2015 年 12 月 28 日	-	5	经济学硕士，2011 年加入国都证券股份有限公司，历任资产管理总部 TMT 行业研究员、投资经理助理，2014 年 9 月-2015 年 6 月任国都安心成长集合资产管理计划投资主办人，2015 年 6 月任国都安心投资集合资产管理计划投资主办人，自 2015 年 12 月 28 日起任国都创新驱动灵活配置混合型证券投资

					基金基金 经理。
程广飞	基金经理	2015 年 12 月 28 日	-	4	中国科学院研究生院工学硕士，北京科技大学计算机学士。历任中国国际金融有限公司创新产品部量化分析师，光大证券股份有限公司量化研究员，国都证券股份有限公司研究所金融工程研究员、金融工程组负责人，自 2015 年 12 月 28 日起任国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

#### 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定和《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基

金无违法、违规行为。本基金投资运作符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金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 5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，市场波动剧烈。新年伊始，市场在人民币汇率变动、熔断机制等多种因素的影响下，市场剧烈调整。随着熔断机制被暂停实施、人民币汇率预期逐渐稳定、美元加息时点推迟、注册制延期推出等利好消息的逐渐出台，前期市场担忧的风险因素趋于弱化，市场极度恐慌情绪逐渐得到缓解。2 月份以后，市场逐渐走出单边下跌的态势，开始进入区间震荡。期间，食品饮料、家电、稀土、黄金、新能源汽车等板块在不同时期领涨市场。

报告期，本基金秉持稳健投资的运作理念，在大类资产上，以持有较大比例的固定收益类资产和现金为主。在股票资产选择上，围绕着行业景气这一核心因素，利用市场休养生息的机会，以转型、创新为主要方向，在食品饮料、新能源、新材料、信息技术等方面，精选个股进行投资布局，取得了一定的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.039 元，份额累计净值 1.039 元，半年度基金份额净值增长率 3.90%。同期基金业绩比较基准-12.36%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准 16.26 个百分点。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2016 年，世界并不太平。从外围看，美国经济逐渐复苏，货币政策逐渐转向，但基础并不牢固；欧盟国家因区域发展不平衡，加之恐怖事件、政府更迭等突发事件的冲击，一体化进程遭受严重挑战。中国经济增长从高速向中高速转变，前期刺激政策带来的产能过剩问题也逐渐暴露，相关行业信用风险暴露。在这样的背景下，全球风险资产在 2016 年都表现欠佳。

展望未来，我们坚定相信中国经济仍然是大有希望的。第一，中央政府推进改革的决心非常大，供给侧改革抓住了问题的关键；第二，我们有世界上最大的中产阶级消费人群，给中国企业转型升级提供了腹地资源；第三，创新创业的氛围在中国社会正在逐渐被接受，新的增长动力正在逐渐培育。

本基金将秉持稳健投资的运作理念，在大类资产上，适时控制仓位，以持有固定收益类资产和现金为主。在股票资产选择上，围绕着行业景气这一核心因素，以转型、创新为主要方向，精选个股进行投资布局，力争为投资者获取较好的稳健回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格，同时，根据公司制定的相关制度，估值工作决策会议成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期末未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净

值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，兴业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、托管协议和其他相关规定，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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	18,898,943.01	191,286,053.02
结算备付金		133,304.50	-
存出保证金		65,500.42	-
交易性金融资产	6.4.7.2	51,481,138.96	755.00
其中：股票投资		51,481,138.96	755.00
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	135,006,375.00	205,005,450.00
应收证券清算款		139,170.12	-
应收利息	6.4.7.5	101,852.44	174,066.54
应收股利		-	-
应收申购款		998.50	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	28,549.80
资产总计		205,827,282.95	396,494,874.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	13,990,633.67
应付赎回款		1,255,291.46	-
应付管理人报酬		260,799.96	47,147.61
应付托管费		43,466.69	7,857.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	21,119.43	6,035.43
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	69,375.53	-
负债合计		1,650,053.07	14,051,674.65
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	196,485,638.46	382,310,068.05
未分配利润	6.4.7.10	7,691,591.42	133,131.66
所有者权益合计		204,177,229.88	382,443,199.71
负债和所有者权益总计		205,827,282.95	396,494,874.36

## 6.2 利润表

会计主体：国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
一、收入		11,894,291.66	-
1.利息收入		2,566,236.86	-

其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,564,680.54	-
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		1,001,556.32	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,085,939.61	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,955,961.36	-
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	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	129,978.25	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,645,621.28	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	596,493.91	-
<b>减：二、费用</b>		2,783,849.52	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,073,757.72	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	345,626.36	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	299,620.86	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	64,844.58	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		9,110,442.14	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		9,110,442.14	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	382,310,068.05	133,131.66	382,443,199.71

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,110,442.14	9,110,442.14
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）	-185,824,429.59	-1,551,982.38	-187,376,411.97
其中：1.基金申购款	1,287,018.06	16,620.03	1,303,638.09
2.基金赎回款	-187,111,447.65	-1,568,602.41	-188,680,050.06
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）	196,485,638.46	7,691,591.42	204,177,229.88
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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

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：

常喆

基金管理人负责人

封欣

主管会计工作负责人

李亚红

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 11 月 11 日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》证监许可（2015）2577 号文核准注册，自 2015 年 12 月 7 日至 2015 年 12 月 21 日公开募集设立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 382,222,568.02 元人民币，业经中准会计师事务所（特殊普通合伙）“中准验字[2015]第 1180 号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金合同》于 2015 年 12 月 28 日正式生效。

基金合同生效日的基金份额总额为 382,310,068.05 份基金单位，其中认购资金利息折合 87,500.03 份基金单位。

本基金基金管理人为国都证券股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、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他金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号〈半年度报告的内容与格式〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间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与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认

金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则: 1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分

配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；4、每一基金份额享有同等分配权；5、在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；

若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的首次发行成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 2016 年 5 月 1 日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴

个人所得税。持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息、红利收入全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	18,898,943.01
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	18,898,943.01

### 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	47,835,520.68	51,481,138.96	3,645,618.28
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	47,835,520.68	51,481,138.96	3,645,618.28

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本报告期末，未持有任何衍生金融资产/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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券	135,006,375.00	-
合计	135,006,375.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末，未持有任何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	40,911.76
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	60.00
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	60,851.28
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	29.40
合计	101,852.44

### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本报告期末，未持有其他应收款、待摊费用等其他资产。

### 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	21,119.43
银行间市场应付交易费用	-

合计	21,119.43
----	-----------

#### 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	4,730.95
预提费用	64,644.58
合计	69,375.53

#### 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	382,310,068.05	382,310,068.05
本期申购	1,287,018.06	1,287,018.06
本期赎回(以“-”号填列)	-187,111,447.65	-187,111,447.65
- 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	196,485,638.46	196,485,638.46

#### 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	133,134.66	-3.00	133,131.66
本期利润	5,464,820.86	3,645,621.28	9,110,442.14
本期基金份额交易产生的变动数	-1,080,311.29	-471,671.09	-1,551,982.38
其中：基金申购款	10,821.80	5,798.23	16,620.03
基金赎回款	-1,091,133.09	-477,469.32	-1,568,602.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,517,644.23	3,173,947.19	7,691,591.42

**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	1,194,953.40
定期存款利息收入	342,222.23
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	27,256.23
其他	248.68
合计	1,564,680.54

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	85,677,697.01
减：卖出股票成本总额	80,721,735.65
买卖股票差价收入	4,955,961.36

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无债券申购价差收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金在本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益****6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期末进行贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金在本报告期无买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属赎回差价收入。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金在本报告期无贵金属申购差价收入。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金在本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	-

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	129,978.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	129,978.25

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,645,621.28
——股票投资	3,645,621.28
——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	3,645,621.28

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	596,289.53
其他	204.38
合计	596,493.91

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	299,620.86
银行间市场交易费用	-
合计	299,620.86

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	49,726.04
银行划款手续费	200.00
合计	64,844.58

### 6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金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

2016 年 4 月 26 日，基金管理人因业务发展需要，根据监管机构相关函复，设立全资子公司国都创业投资有限责任公司从事直接投资业务；除此之外，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
国都证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金的证券经纪商
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都期货有限公司	基金管理人的控股子公司、基金的期货经纪商

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度可比期间。

### 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
国都证券股份	213,873,741.53	100.00%	-	-

注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本报告期本基金未通过关联方交易单元进行涉及支付关联方费用的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
国都证券股份	3,594,000,000.00	100.00%	-	-

注：本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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
国都证券股份 有限公司	246,491.42	100.00%	21,119.43	100.00%
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

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度同期对比数据。

2、上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等。

3、关联方符合本基金管理人选择证券经营机构、使用其交易单元作为基金专用交易单元的标准。

## 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	2,073,757.72	-
其中：支付销售机构的客户维护费	678,253.10	-

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、实际支付销售机构的客户维护费以本基金管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

3、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度同期对比数据。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	345,626.36	-

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托

管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

#### 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

注：本基金本报告期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

注：报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

注：本基金其他关联方在本报告期末未持有本基金。

#### 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 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
兴业银行股份有限公司	18,898,943.01	1,448,981.18	-	-

注：1、本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同生效日为 2015 年 12 月 28 日，无上年度同期对比数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在承销期内未参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期没有需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

## 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
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	-

### 6.4.12.2 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
300353	东土科技	2016 年 6 月 23 日	临时停牌	22.09	-	-	100,000	1,719,595.00	2,209,000.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有在银行间市场正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人根据发展战略、经营目标及资本实力制定风险管理政策，确定风险偏好、风险

容忍度、风险限额等内容。风险管理政策根据内外部情况及时调整。

本基金管理人严格防范合规风险，积极管理声誉风险，控制流动性风险和操作风险。承担适度规模的市场风险和信用风险，并以分散、对冲、转移、补偿、缓释等策略和工具积极管理。

本基金管理人风险管理的组织架构分为五个层次：

第一层次为重要一线岗位双人、双职、双责为基础的相互制衡；

第二层次为各业务的风险管理，业务部门、后台部门之间，相关岗位之间的相互制衡；

第三层次为内部控制部门（执行合规管理、风险管理、法律事务和稽核审计职能的部门）对各业务、各部门、各分支机构、各岗位全面实时监控、检查和评价；

第四层次为本基金管理人管理层及其下属的专业委员会，董事会及董事会风险控制委员、审计委员会的风险管理；

第五层次为监事会的风险管理。

#### **6.4.13.2 信用风险**

指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资债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。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金本报告期末持有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**

注：本基金本报告期末持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

指基金资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在开放式基金交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响基金份额净值。

##### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

#### **6.4.13.4 市场风险**

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将对本基金资产产生潜在风险，主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致证券价格波动而产生风险。

## 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，基金投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

## 3、购买力风险

本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

## 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

### 6.4.13.4.1 利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。基金投资于证券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 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	18,898,943.01	-	-	-	-	-	18,898,943.01
结算备付金	133,304.50	-	-	-	-	-	133,304.50
存出保证金	65,500.42	-	-	-	-	-	65,500.42
交易性金融资产	-	-	-	-	-	51,481,138.96	51,481,138.96
买入返售金融资产	135,006,375.00	-	-	-	-	-	135,006,375.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	139,170.12	139,170.12
应收利息	-	-	-	-	-	101,852.44	101,852.44
应收申购款	-	-	-	-	-	998.50	998.50
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	154,104,122.93	-	-	-	-	51,723,160.02	205,827,282.95
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,255,291.46	1,255,291.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	260,799.96	260,799.96
应付托管费	-	-	-	-	-	43,466.69	43,466.69

应付交易费用	-	-	-	-	-	21,119.43	21,119.43
其他负债	-	-	-	-	-	69,375.53	69,375.53
负债总计	-	-	-	-	-	1,650,053.07	1,650,053.07
利率敏感度缺口	154,104,122.93	-	-	-	-	50,073,106.95	204,177,229.88
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	191,286,053.02	-	-	-	-	-	-191,286,053.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	755.00	755.00
买入返售金融资产	205,005,450.00	-	-	-	-	-	-205,005,450.00
应收利息	-	-	-	-	-	174,066.54	174,066.54
其他资产	-	-	-	-	-	28,549.80	28,549.80
资产总计	396,291,503.02	-	-	-	-	203,371.34	396,494,874.36
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,990,633.67	13,990,633.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	47,147.61	47,147.61
应付托管费	-	-	-	-	-	7,857.94	7,857.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,035.43	6,035.43
其他负债	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	14,051,674.65	14,051,674.65
利率敏感度缺口	396,291,503.02	-	-	-	-	-13,848,303.31	382,443,199.71

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及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

注：本基金本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本基金本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对基金资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场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，所面临的最大市场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市场价格风险，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。

## 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	51,481,138.96	25.21	755.00	0.00
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,481,138.96	25.21	755.00	0.00

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	根据期末时点本基金股票资产组合相对于沪深 300 指数的 Beta 系数计算基金资产变动		
	Beta 系数以市场过去 100 个交易日的数据建立回归模型计算得到，对于新股或者股票交易不足 100 个交易日的股票，默认其波动与市场同步		
	假定沪深 300 指数变动 5%，其他市场变量均不发生变化，计算本基金资产净值变动		
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）
	沪深 300 指数下跌 5%	-3,099,128.84	0.00
	沪深 300 指数上涨 5%	3,099,128.84	0.00

## 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金在 95% 的置信水平，以过去 100 个交易日为风险样本观察期，计算前瞻天数为 1 天的风险价值。本期末本基金风险价值为 2,691,858.57 元，占基金资产净值比例为 1.32%。

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 06 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 51,481,138.96 元，无属于第二层次、第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本基金采用第三方估值机构根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将相关债券的公允价值确定为第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	51,481,138.96	25.01
	其中：股票	51,481,138.96	25.01
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	135,006,375.00	65.59
	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	19,032,247.51	9.25
7	其他各项资产	307,521.48	0.15
8	合计	205,827,282.95	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,708,200.00	0.84
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,875,856.61	13.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,107,400.00	2.01
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	5,079,032.35	2.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	3,218,800.00	1.58
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	2,009,150.00	0.98
R	文化、体育和娱乐业	7,482,700.00	3.66
S	综合	-	-
	合计	51,481,138.96	25.21

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

### 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	601607	上海医药	200,000	3,610,000.00	1.77
2	300367	东方网力	140,000	3,476,200.00	1.70
3	000568	泸州老窖	115,000	3,415,500.00	1.67
4	300291	华录百纳	140,000	3,294,200.00	1.61
5	300012	华测检测	260,000	3,218,800.00	1.58
6	600312	平高电气	170,000	2,662,200.00	1.30
7	300144	宋城演艺	100,000	2,491,000.00	1.22
8	300136	信维通信	110,100	2,307,696.00	1.13
9	300353	东土科技	100,000	2,209,000.00	1.08
10	300015	爱尔眼科	55,000	2,009,150.00	0.98
11	300285	国瓷材料	50,000	1,994,500.00	0.98
12	300274	阳光电源	80,000	1,952,000.00	0.96
13	300075	数字政通	70,000	1,795,500.00	0.88
14	000998	隆平高科	90,000	1,708,200.00	0.84
15	000400	许继电气	110,000	1,698,400.00	0.83
16	002343	慈文传媒	35,000	1,697,500.00	0.83
17	000049	德赛电池	40,000	1,677,600.00	0.82
18	600271	航天信息	65,000	1,547,000.00	0.76
19	002570	贝因美	120,000	1,534,800.00	0.75

20	002368	太极股份	40,000	1,421,200.00	0.70
21	002601	佰利联	90,000	1,255,500.00	0.61
22	002410	广联达	80,000	1,144,000.00	0.56
23	300267	尔康制药	70,267	1,006,223.44	0.49
24	000876	新希望	120,000	998,400.00	0.49
25	300287	飞利信	50,000	670,000.00	0.33
26	603883	老百姓	10,000	497,400.00	0.24
27	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.03
28	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
29	300518	盛讯达	833	39,026.05	0.02
30	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
31	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
32	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	000858	五粮液	6,149,123.20	1.61
2	000568	泸州老窖	5,235,958.07	1.37
3	300353	东土科技	5,046,528.92	1.32
4	300291	华录百纳	4,963,076.00	1.30
5	002410	广联达	4,410,492.00	1.15
6	000596	古井贡酒	4,041,932.00	1.06
7	600887	伊利股份	4,021,000.00	1.05
8	002426	胜利精密	3,722,512.00	0.97
9	300367	东方网力	3,570,790.00	0.93
10	601607	上海医药	3,376,975.00	0.88
11	002343	慈文传媒	3,144,529.00	0.82
12	300166	东方国信	2,927,320.00	0.77
13	300075	数字政通	2,877,950.00	0.75
14	300274	阳光电源	2,843,750.00	0.74
15	300012	华测检测	2,778,400.00	0.73
16	002385	大北农	2,733,073.00	0.71
17	600312	平高电气	2,676,434.00	0.70

18	600138	中青旅	2,524,702.60	0.66
19	000725	京东方A	2,520,000.00	0.66
20	603883	老百姓	2,513,500.00	0.66

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	6,746,905.00	1.76
2	000596	古井贡酒	4,588,120.00	1.20
3	002426	胜利精密	4,227,193.80	1.11
4	600887	伊利股份	4,115,163.00	1.08
5	300353	东土科技	3,800,381.00	0.99
6	002410	广联达	3,640,455.50	0.95
7	002385	大北农	3,071,436.00	0.80
8	300166	东方国信	2,925,554.00	0.76
9	002407	多氟多	2,807,140.00	0.73
10	600519	贵州茅台	2,603,000.00	0.68
11	000725	京东方A	2,550,283.00	0.67
12	000568	泸州老窖	2,537,347.00	0.66
13	600138	中青旅	2,433,822.20	0.64
14	300452	山河药辅	2,410,233.00	0.63
15	000860	顺鑫农业	2,263,325.04	0.59
16	603883	老百姓	2,193,900.00	0.57
17	300352	北信源	2,182,557.05	0.57
18	300224	正海磁材	2,126,307.00	0.56
19	002567	唐人神	2,108,064.00	0.55
20	600809	山西汾酒	2,085,470.19	0.55

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	128,556,498.33
卖出股票收入（成交）总额	85,677,697.01

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 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

注：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

本基金投资股指期货以对冲系统性风险为目的，达到套期保值目的。基金管理人动态调整股指期货合约持仓品种、持仓数量，与现货相匹配，控制风险，并驻留相对收益。

## 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

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	65,500.42
2	应收证券清算款	139,170.12
3	应收股利	-
4	应收利息	101,852.44
5	应收申购款	998.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	307,521.48

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券投资。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300353	东土科技	2,209,000.00	1.08	临时停牌

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,843	51,128.19	2,178,910.82	1.11%	194,306,727.64	98.89%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	-

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	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（2015年12月28日）基金份额总额	382,310,068.05
本报告期期初基金份额总额	382,310,068.05
本报告期基金总申购份额	1,287,018.06
减：本报告期基金总赎回份额	187,111,447.65
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	196,485,638.46

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开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

经国都证券股份有限公司董事会和股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会北京监管局《关于翁振杰证券公司董事任职资格的批复》（京证监许可[2016]10 号）核准，翁振杰先生自 2016 年 2 月 26 日起履任国都证券股份有限公司董事，其任期与本届董事会一致。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

经国都证券股份有限公司董事会和股东大会审议通过，并经中国证券监督管理委员会北京监管局《关于核准李敬伟证券公司独立董事任职资格的批复》（京证监许可[2016]36 号）核准，李敬伟先生自 2016 年 6 月 15 日起履任国都证券股份有限公司董事，其任期与本届董事会一致。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门不存在重大人事变动情况。

### 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，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼；涉及基金管理人的未决诉讼有 2 件，包括：国都证券股份有限公司（原告）诉客户甄某（被告）融资融券交易纠纷案、北京东方新略人力资源顾问有限公司（原告）诉国都证券股份有限公司北京工体北路证券营业部（被告）及北京职工体育服务中心（第三人）返还原物纠纷案。

注：上述涉及基金管理人的未决诉讼均不会对基金管理人日常经营造成重大影响，亦不会对基金管理人履行基金管理职责造成影响。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是中准会计师事务所（特殊普通合伙）。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	2	213,873,741.53	100.00%	246,491.42	100.00%	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金合同于 2015 年 12 月 28 日生效，上表所列示券商交易单元均为 2015 年内新增。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国都证券	-	-	3,594,000,000.00	100.00%	-	-

**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	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金-基金份额发售公告	指定报刊、网站	2015 年 11 月 30 日
2	国都证券股份有限公司关于新增华福证券有限责任公司为国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金代销机构的公告	指定报刊、网站	2015 年 12 月 11 日

3	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	指定报刊、网站	2015 年 12 月 18 日
4	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金（002020）基金合同生效公告	指定报刊、网站	2015 年 12 月 29 日
5	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金（002020）基金经理任职公告	指定报刊、网站	2015 年 12 月 29 日
6	国都证券股份有限公司董事会成员变更公告	指定报刊、网站	2015 年 12 月 30 日
7	国都证券股份有限公司关于指数熔断实施期间调整旗下相关基金开放时间的公告	指定报刊、网站	2015 年 12 月 31 日
8	国都证券股份有限公司关于变更法定代表人并修改公司章程相应条款的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 11 日
9	国都证券股份有限公司关于变更股东及其出资比例、增加注册资本和股份总数并修改公司章程相应条款的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 18 日
10	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	指定报刊、网站	2016 年 1 月 28 日
11	国都证券股份有限公司关于董事会成员任职的公告	指定报刊、网站	2016 年 3 月 2 日
12	国都证券股份有限公司关于国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金参与申购费率优惠活动的公告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 8 日

13	国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	指定报刊、网站	2016 年 4 月 22 日
14	国都证券股份有限公司关于董事会成员任职的公告	指定报刊、网站	2016 年 6 月 17 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 2、《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国都创新驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人网站 [www.guodu.com](http://www.guodu.com)

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（[www.guodu.com](http://www.guodu.com)）查阅。

国都证券股份有限公司  
2016 年 8 月 26 日