

泓德泓益量化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：泓德基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年8月27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。

基金托管人中国工商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4月26日(合同生效日)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
1.2 目录.....	3
§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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	11
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53

§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 备查文件目录.....	58
11.1 备查文件目录.....	58
11.2 存放地点.....	59
11.3 查阅方式.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓益量化混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓益量化混合
基金主代码	002562
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月26日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	309,604,858.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化投资模型，在严格控制风险的前提下，合理配置资产权重，精选个股，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产长期稳健增值。
投资策略	<p>基金管理人主要以宏观政策、微观行业、市场情绪为基础，构建中短期系统风险模型，进行市场风险的主动判断，为基金仓位积极调整和利用股指期货管理系统风险提供准确的量化依据。</p> <p>本基金通过合理确定股票、股指期货、债券、现金等金融工具上的投资比例，达到控制净值大幅回撤风险，改善投资组合的风险收益特性的目的。</p> <p>在股票投资中，本基金将运用基金管理人开发的"多因子阿尔法模型"、"行业轮动模型"、"事件驱动模型"等各类量化模型进行股票选择并据此构建股票投资组合。在实际运行过程中，将定期或不定期的进行修正，优化股票投资组合。本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风</p>

	险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货投资。
业绩比较基准	中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	洪渊
	联系电话	010-59850177	010-66105799
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59322130	010-66105798
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	易会满

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	http://www.hongdefund.com

基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所
-------------	----------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125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4月26日至2016年6月30日）
本期已实现收益	347,540.10
本期利润	11,032,557.89
加权平均基金份额本期利润	0.0356
本期加权平均净值利润率	3.55%
本期基金份额净值增长率	3.60%
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	347,540.10
期末可供分配基金份额利润	0.0011
期末基金资产净值	320,637,416.26
期末基金份额净值	1.036
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	3.60%

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

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

3、期末可供分配利润，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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、本基金基金合同生效日为2016年4月26日，本年度财务报表的实际编制期间为2016年4月26日至2016年6月30日。

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	2.57%	0.52%	0.56%	0.91%	2.01%	-0.39%
自基金合同生效日起至 至今（2016年04月26 日-2016年06月30日）	3.60%	0.39%	0.68%	0.94%	2.92%	-0.55%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

业绩比较基准：中证800指数收益率×80%+中证综合债券指数×20%

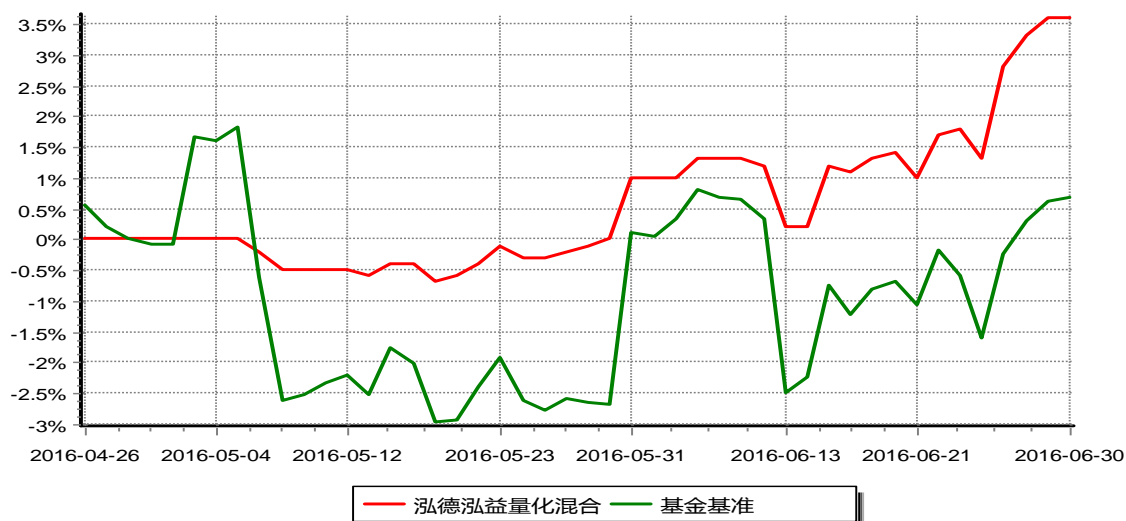
基准指数的构建原则如下：

(1)中证800指数是由中证指数有限公司编制的，其成份股由中证500指数和沪深300指数成份股一起构成，较好地反映了 A 股市场的总体趋势。

(2)中证综合债券指数是中国全市场债券指数，以2001年12月31日为基期，基点为100点，并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

(3)由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注：1)本基金的基金合同于2016年4月26日生效，截至2016年6月30日止，本基金成立未满1年。
 2)本基金的建仓期为6个月，截至2016年6月30日止，本基金建仓期尚未结束。
 3) 建仓期结束后，本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于2015年3月3日，是我国第一家由专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币12,000万元，公司注册地在拉萨市。目前，公司股东及其出资比例为：王德晓26%，阳光保险集团股份有限公司25%，珠海市基业长青股权投资基金（有限合伙）16.667%，南京民生租赁股份有限公司13.875%，江苏岛村实业发展有限公司13.875%，上海捷朔信息技术有限公司4.583%。截至2016年6月30日，总资产管理规模为231.27亿元，其中：公募基金管理规模129.63亿元，专户产品管理规模101.64亿元。公司发行九只公募基金产品以及多只专户产品，包括：偏股型基金七只、债券型基金、货币基金各一只，完成了从权益类产品到固定收益类产品、从公募基金到专户的全方位产品布局。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

郭堃	本基金基金经理	2016年4月26日	—	5年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任阳光资产管理股份有限公司行业研究部新能源及家电行业分析师、制造业研究组组长。2015年11月至今担任泓德战略转型股票型证券投资基金基金经理，2016年4月至今担任泓德泓益量化混合型证券投资基金基金经理，2016年6月至今担任泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
苏昌景	本基金基金经理	2016年4月29日	—	8年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任国都证券股份有限公司研究所金融工程研究员，资产管理总部总经理助理、投资经理。2016年4月至今担任泓德泓益量化混合型证券投资基金基金经理。

注：①对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》及其各项实施细则、《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

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

本基金在四月底成立，在成功地避开了5月上旬市场的下跌之后，开始逐步稳健建仓。

股票组合方面，本基金以基准指数中证800的行业配置比例作为战略性长期均衡配置比例，利用"成长模型"、"价值模型"以及"预期模型"这些符合不同市场行情特点、具有不同风险收益特征的模型筛选预期收益较好的股票构成投资组合，从而有效分散单一策略的投资风险。股指期货方面，报告期间股指期货合约大幅贴水，本基金买入开仓一定比例的股指期货头寸，以期获取比较确定的超额收益。

截至二季度末，本基金已经基本上完成了建仓，投资操作已步入正轨，股票资产仓位合计约为57%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，泓德泓益量化混合的基金份额净值为1.036元，本报告期份额净值增长率为3.6%，同期业绩比较基准增长率为0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年随着政策重心回归"供给侧"、前期稳增长措施效果逐步淡化、房地产增速见顶回落，经济增长可能会重回增速缓降的局面。行业方面结构分化，新经济消费相关行业预期平稳，原材料周期性行业则预期会大起大落。展望下半年的证券市场，虽然供给侧及国企改革进展可能会激发局部的人气，但综合来看，中小市值高估值领域估值下行

压力相对较大，我们认为第三季度的阶段性机会可能需要在市场有所调整之后才会更加明显。

本基金在投资过程中将严格按照经过实证检验的量化投资策略进行投资管理，减少人为主观情绪及个人判断的失误概率。下半年的投资操作上，我们将按照量化模型在行业均衡配置的基础上精选个股，在未来市场行情波动下规避追涨杀跌，在市场调整过程中逐步增加权益类持仓比例至业绩比较基准水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理、督察长、研究部、监察稽核部、运营支持部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金报告期内未实施利润分配。

本基金截至2016年6月30日，期末可供分配利润为347,540.10元，其中：未分配利润已实现部分为347,540.10元，未分配利润未实现部分为10,685,017.79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

本报告期内本基金不存在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

本报告期内，本基金托管人在对泓德泓益量化混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，泓德泓益量化混合型证券投资基金的管理人--泓德基金管理有限公司在泓德泓益量化混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，泓德泓益量化混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的泓德泓益量化混合型证券投资基金2016年上半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德泓益量化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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	2,560,916.40

结算备付金		14,097,173.67
存出保证金		6,192,745.59
交易性金融资产	6.4.7.2	240,478,687.73
其中：股票投资		183,180,282.93
基金投资		—
债券投资		57,298,404.80
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	59,500,000.00
应收证券清算款		—
应收利息	6.4.7.5	927,889.72
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		323,757,413.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		2,490,336.40
应付赎回款		—
应付管理人报酬		385,905.65
应付托管费		51,454.10
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	160,620.70

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	31,680.00
负债合计		3,119,996.85
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	309,604,858.37
未分配利润	6.4.7.10	11,032,557.89
所有者权益合计		320,637,416.26
负债和所有者权益总计		323,757,413.11

注：(1)报告截止日2016年6月30日，基金份额净值为人民币1.036元，基金份额总额为309,604,858.37份。

(2)本基金合同于2016年4月26日生效，本年度财务报表的实际编制期间为2016年4月26日至2016年6月30日，无上年度可比期间。

6.2 利润表

会计主体：泓德泓益量化混合型证券投资基金

本报告期：2016年4月26日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年4月26日至2016年6月30日
一、收入		12,211,748.10
1.利息收入		826,817.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	239,002.90
债券利息收入		162,735.15
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		425,079.70
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		699,912.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	228,209.19

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	471,703.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	10,685,017.79
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	—
减：二、费用		1,179,190.21
1. 管理人报酬		828,881.95
2. 托管费		110,517.61
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	202,432.16
5. 利息支出		2,609.49
其中：卖出回购金融资产支出		2,609.49
6. 其他费用	6.4.7.19	34,749.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,032,557.89
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,032,557.89

注：本基金合同于2016年4月26日生效，无上年度可比期间。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泓德泓益量化混合型证券投资基金

本报告期：2016年4月26日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年4月26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)	309,604,858.37	—	309,604,858.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	11,032,557.89	11,032,557.89
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)	309,604,858.37	11,032,557.89	320,637,416.26

注：本基金合同于2016年4月26日生效，无上年度可比期间。

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：

王德晓

王德晓

李娇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德泓益量化混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2016]304号《关于准予泓德泓益量化混合型证券投资基金注册的批复》核准，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集309,594,050.44元，且经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第483号验资报

告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》于2016年4月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为309,604,858.37份,其中认购资金利息折合10,807.93份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标为通过数量化投资模型,在严格控制风险的前提下,合理配置资产权重,精选个股,追求超越业绩比较基准的投资回报和产长期稳健增值。本基金的投资范围包括国内依法发行上市交易的股票(包括中小板、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、金融债、企业债、公司债、央行票据、次级债、可转换债券、可交换债券、中小企业私募债等)、银行存款(包括通知存款、定期存款、协议存款等)、资产支持证券、大额存单、债券回购、权证、股指期货、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。本基金的投资组合比例为:股票投资比例为基金资产的60%-95%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证800指数收益率 \times 80%+中证综合债券指数收益率 \times 20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况以及2016年4月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年4月26日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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卖出回购金融资产款和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(主要为权证投资)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的事件的，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。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。

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或者发行价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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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初始投资成本，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)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)，按照中证指数有限公司根据《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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(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	2,560,916.40
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—

合计	2,560,916.40
----	--------------

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		175,848,570.78	183,180,282.93	7,331,712.15
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	15,999,458.50	15,982,404.80	-17,053.70
	银行间市场	41,203,960.66	41,316,000.00	112,039.34
	合计	57,203,419.16	57,298,404.80	94,985.64
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		233,051,989.94	240,478,687.73	7,426,697.79

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			
	名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	—	—	
其中：股指期货投资	26,153,920.00	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	26,153,920.00	—	—	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：	合约市值(元)	公允价值变动(元)

		手)		
IC1612	中证 500 股指期货 1612 合约	26	29,412,240.00	3,258,320.00
总额合计				3,258,320.00
减：可抵消期货暂收款				3,258,320.00
股指期货投资净额				0.00

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
交易所市场	59,500,000.00	—
合计	59,500,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	4,553.62
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	4,361.24
应收债券利息	918,968.29
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	6.57

合计	927,889.72
----	------------

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	158,856.24
银行间市场应付交易费用	1,764.46
合计	160,620.70

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	—
预提费用	31,680.00
合计	31,680.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年4月26日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	309,604,858.37	309,604,858.37
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	309,604,858.37	309,604,858.37

注：本基金自2016年3月24日至2016年4月22日止期间公开发售，共募集有效净认购资金309,594,050.44元。根据《泓德泓益量化混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入10,807.93元。在本基金成立后，折算为10,807.93份基金份额，划入基

金份额持有人账户。

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	—	—	—
本期利润	347,540.10	10,685,017.79	11,032,557.89
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	347,540.10	10,685,017.79	11,032,557.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年4月26日至2016年6月30日
活期存款利息收入	75,465.90
定期存款利息收入	147,666.66
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	15,847.76
其他	22.58
合计	239,002.90

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月26日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	22,847,107.04
减：卖出股票成本总额	22,618,897.85
买卖股票差价收入	228,209.19

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金于2016年4月26日（基金合同生效日）至2016年6月30日止期间无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月26日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	471,703.37
基金投资产生的股利收益	—
合计	471,703.37

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月26日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	7,426,697.79
——股票投资	7,331,712.15
——债券投资	94,985.64
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	3,258,320.00
——权证投资	—
期货投资	3,258,320.00
3.其他	—
合计	10,685,017.79

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月26日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	202,032.16
银行间市场交易费用	400.00
合计	202,432.16

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月26日至2016年6月30日
审计费用	14,256.00
信息披露费	17,424.00
开户费	400.00
汇划手续费	2,669.00
合计	34,749.00

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，本基金无须做说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的重大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**

本报告期不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。

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
泓德基金管理有限公司(以下简称"泓德基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金于2016年4月26日（基金合同生效日）至2016年6月30日止期间未通过关联方交易单元进行交易。

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4月26日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	828,881.95
其中：支付销售机构的客户维护费	954.34

注：1、本基金合同于2016年4月26日生效，无上年度可比期间。

2、支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值X 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年4月26日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托	110,517.61

管费	
----	--

注：1、本基金合同于2016年4月26日生效，无上年度可比期间。

2、支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于2016年4月26日（基金合同生效日）至2016年6月30日止期间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

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

本基金本报告期末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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4月26日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,560,916.40	75,465.90

注：1、本基金合同于2016年4月26日生效，无上年度可比期间。

2、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于2016年4月26日（基金合同生效日）至2016年6月30日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期间本基金未发生其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于2016年4月26日（基金合同生效日）至2016年6月30日止期间未进行利润分配。

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	期末成本总额	期末估值总额	说明
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股未上市	12.98	12.98	2,575	33,423.5	33,423.5	
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股未上市	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8	
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股未上市	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3	

注：注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量	期末成本总额	期末估值总额	说明
600759	洲际油气	2016-06-27	重大资产重组	7.58	2016-07-11	8.10	55,300	432,763.00	419,174.00	
600986	科达股份	2016-06-27	重大资产重组	15.98	2016-07-18	17.58	24,200	392,336.82	386,716.00	
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	25,500	415,119.00	426,360.00	
000802	北京文化	2016-06-01	重大事项	23.52	2016-08-22	21.86	1,200	28,089.00	28,224.00	
002465	海格通信	2016-06-13	重大事项	12.44		—	10,000	117,213.00	124,400.00	
002713	东易日盛	2016-06-29	重大资产重组	29.03	2016-07-20	31.93	27,700	781,830.00	804,131.00	

300166	东方国信	2016-06-08	重大资产重组	27.47		—	4,769	127,427.68	131,004.43	
300345	红宇新材	2016-06-21	重大事项	10.46	2016-07-19	11.46	16,340	160,876.40	170,916.40	
300246	宝莱特	2016-06-27	重大事项	30.31	2016-07-01	32.20	12,200	385,560.00	369,782.00	

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

于2016年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净值的比例为6.66%

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的账户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市和银行间同业市场交易，除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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

除6.4.13.4.1.1中列示的卖出回购金融资产款外，本基金所承担的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且

不计息，因此账面余额即约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,560,916.40	—	—	—	2,560,916.40
结算备付金	14,097,173.67	—	—	—	14,097,173.67
存出保证金	6,192,745.59	—	—	—	6,192,745.59
交易性金融资产	35,948,404.80	21,350,000.00	—	183,180,282.93	240,478,687.73
买入返售金融资产	59,500,000.00	—	—	—	59,500,000.00
应收利息	—	—	—	927,889.72	927,889.72

资产总计	118,299,240.46	21,350,000.00	—	184,108,172.65	323,757,413.11
负债					
应付证券清算款	—	—	—	2,490,336.40	2,490,336.40
应付管理人报酬	—	—	—	385,905.65	385,905.65
应付托管费	—	—	—	51,454.10	51,454.10
应付交易费用	—	—	—	160,620.70	160,620.70
其他负债	—	—	—	31,680.00	31,680.00
负债总计	—	—	—	3,119,996.85	3,119,996.85
利率敏感度缺口	118,299,240.46	21,350,000.00	—	180,988,175.80	320,637,416.26

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2016年6月30日
	市场利率上升25个基点	-37,542.12
	市场利率下降25个基点	37,852.79

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围60-95%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	183,180,282.93	57.13
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	183,180,282.93	57.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	183,180,282.93	56.58
	其中：股票	183,180,282.93	56.58
2	固定收益投资	57,298,404.80	17.70
	其中：债券	57,298,404.80	17.70
	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	59,500,000.00	18.38
	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	16,658,090.07	5.15
7	其他各项资产	7,120,635.31	2.20
8	合计	323,757,413.11	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,133,460.68	0.67
B	采矿业	4,269,126.00	1.33
C	制造业	88,369,716.47	27.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,266,781.00	1.33
E	建筑业	4,017,700.80	1.25
F	批发和零售业	6,627,385.99	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	5,097,505.82	1.59
H	住宿和餐饮业	—	—

I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,153,710.29	2.23
J	金融业	40,400,447.92	12.60
K	房地产业	10,402,524.28	3.24
L	租赁和商务服务业	1,790,029.70	0.56
M	科学研究和技术服务业	2,047,592.10	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	975,879.28	0.30
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	5,069,298.60	1.58
S	综合	559,124.00	0.17
	合计	183,180,282.93	57.13

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	869,176	8,161,562.64	2.55
2	002142	宁波银行	376,118	5,559,024.04	1.73
3	600705	中航资本	690,510	4,060,198.80	1.27
4	601318	中国平安	123,300	3,950,532.00	1.23
5	000666	经纬纺机	165,800	3,233,100.00	1.01
6	600000	浦发银行	174,140	2,711,359.80	0.85
7	000001	平安银行	253,780	2,207,886.00	0.69
8	601166	兴业银行	128,300	1,955,292.00	0.61
9	600999	招商证券	108,500	1,790,250.00	0.56
10	000166	申万宏源	211,800	1,781,238.00	0.56
11	002262	恩华药业	88,390	1,781,058.50	0.56
12	600030	中信证券	105,900	1,718,757.00	0.54
13	600340	华夏幸福	69,120	1,685,145.60	0.53

14	601601	中国太保	61,866	1,672,856.64	0.52
15	601169	北京银行	161,100	1,670,607.00	0.52
16	600038	中直股份	39,055	1,620,001.40	0.51
17	600885	宏发股份	46,206	1,418,986.26	0.44
18	000563	陕国投 A	252,800	1,387,872.00	0.43
19	002554	惠博普	190,000	1,368,000.00	0.43
20	600109	国金证券	99,900	1,346,652.00	0.42
21	300054	鼎龙股份	52,300	1,308,546.00	0.41
22	600007	中国国贸	63,200	1,276,640.00	0.40
23	300370	安控科技	109,967	1,249,225.12	0.39
24	000887	中鼎股份	56,100	1,240,371.00	0.39
25	600483	福能股份	105,100	1,192,885.00	0.37
26	002357	富临运业	68,860	1,062,509.80	0.33
27	600198	大唐电信	52,600	1,045,688.00	0.33
28	600236	桂冠电力	151,800	1,020,096.00	0.32
29	000036	华联控股	122,282	1,003,935.22	0.31
30	002624	完美环球	26,100	985,275.00	0.31
31	002367	康力电梯	63,100	971,740.00	0.30
32	300065	海兰信	25,000	967,000.00	0.30
33	601607	上海医药	53,100	958,455.00	0.30
34	300360	炬华科技	42,300	957,249.00	0.30
35	002426	胜利精密	96,300	948,555.00	0.30
36	600271	航天信息	39,800	947,240.00	0.30
37	300012	华测检测	75,800	938,404.00	0.29
38	300324	旋极信息	43,550	934,583.00	0.29
39	002626	金达威	54,300	914,955.00	0.29
40	600217	秦岭水泥	120,500	913,390.00	0.28
41	600372	中航电子	45,500	885,885.00	0.28
42	601965	中国汽研	91,775	881,957.75	0.28
43	002051	中工国际	44,540	876,101.80	0.27

44	002074	国轩高科	21,600	852,552.00	0.27
45	300136	信维通信	40,500	848,880.00	0.26
46	601313	江南嘉捷	58,200	842,736.00	0.26
47	600303	曙光股份	56,500	839,025.00	0.26
48	000969	安泰科技	59,600	836,188.00	0.26
49	600366	宁波韵升	34,900	833,063.00	0.26
50	002719	麦趣尔	16,908	821,390.64	0.26
51	300115	长盈精密	39,809	820,065.40	0.26
52	002023	海特高新	46,900	812,777.00	0.25
53	300146	汤臣倍健	60,000	812,400.00	0.25
54	002713	东易日盛	27,700	804,131.00	0.25
55	000722	湖南发展	57,900	800,757.00	0.25
56	601098	中南传媒	44,100	798,651.00	0.25
57	601233	桐昆股份	73,300	796,038.00	0.25
58	600391	成发科技	20,700	795,915.00	0.25
59	002481	双塔食品	108,900	794,970.00	0.25
60	300101	振芯科技	28,400	793,212.00	0.25
61	002614	蒙发利	66,001	792,672.01	0.25
62	000333	美的集团	33,250	788,690.00	0.25
63	600519	贵州茅台	2,700	788,184.00	0.25
64	600048	保利地产	91,200	787,056.00	0.25
65	300137	先河环保	53,200	786,828.00	0.25
66	600711	盛屯矿业	105,800	782,920.00	0.24
67	300342	天银机电	25,500	776,730.00	0.24
68	000876	新希望	93,200	775,424.00	0.24
69	600395	盘江股份	93,400	771,484.00	0.24
70	000418	小天鹅A	23,300	760,046.00	0.24
71	000100	TCL 集团	230,600	758,674.00	0.24
72	002048	宁波华翔	32,700	747,849.00	0.23
73	002595	豪迈科技	34,772	743,077.64	0.23

74	300008	天海防务	22,300	742,590.00	0.23
75	002305	南国置业	129,623	728,481.26	0.23
76	002285	世联行	93,200	726,028.00	0.23
77	600660	福耀玻璃	51,700	723,800.00	0.23
78	601311	骆驼股份	36,200	718,570.00	0.22
79	600702	沱牌舍得	28,000	706,720.00	0.22
80	600074	保千里	46,700	696,764.00	0.22
81	002366	台海核电	12,500	666,375.00	0.21
82	002425	凯撒股份	30,000	660,000.00	0.21
83	600693	东百集团	97,800	657,216.00	0.20
84	002329	皇氏集团	43,600	653,564.00	0.20
85	300144	宋城演艺	26,000	647,660.00	0.20
86	601579	会稽山	44,700	632,058.00	0.20
87	600029	南方航空	88,900	627,634.00	0.20
88	601799	星宇股份	13,500	618,570.00	0.19
89	002033	丽江旅游	48,446	614,295.28	0.19
90	000858	五粮液	18,800	611,564.00	0.19
91	000895	双汇发展	28,700	599,256.00	0.19
92	600498	烽火通信	24,600	597,288.00	0.19
93	600392	盛和资源	36,100	591,318.00	0.18
94	600185	格力地产	95,100	590,571.00	0.18
95	601933	永辉超市	142,600	588,938.00	0.18
96	000928	中钢国际	46,200	581,196.00	0.18
97	600325	华发股份	52,300	578,961.00	0.18
98	600386	北巴传媒	30,000	559,800.00	0.17
99	600895	张江高科	30,925	559,124.00	0.17
100	300017	网宿科技	8,300	557,760.00	0.17
101	000729	燕京啤酒	72,900	553,311.00	0.17
102	000860	顺鑫农业	23,200	551,696.00	0.17
103	600028	中国石化	116,500	549,880.00	0.17

104	002016	世荣兆业	66,500	549,290.00	0.17
105	300310	宜通世纪	14,380	549,172.20	0.17
106	000980	金马股份	48,766	543,253.24	0.17
107	002041	登海种业	34,842	541,444.68	0.17
108	600398	海澜之家	47,340	534,942.00	0.17
109	601777	力帆股份	44,700	526,119.00	0.16
110	300182	捷成股份	30,731	525,807.41	0.16
111	000090	天健集团	59,720	525,536.00	0.16
112	002123	荣信股份	25,200	523,908.00	0.16
113	002501	利源精制	48,400	522,720.00	0.16
114	300287	飞利信	38,900	521,260.00	0.16
115	002400	省广股份	36,790	519,842.70	0.16
116	600735	新华锦	36,900	517,707.00	0.16
117	300267	尔康制药	36,000	515,520.00	0.16
118	000863	三湘股份	55,951	514,749.20	0.16
119	600350	山东高速	96,700	512,510.00	0.16
120	601333	广深铁路	130,600	510,646.00	0.16
121	002322	理工环科	26,900	509,486.00	0.16
122	600633	浙报传媒	33,800	508,352.00	0.16
123	300133	华策影视	32,580	507,270.60	0.16
124	600221	海南航空	159,700	506,249.00	0.16
125	600548	深高速	64,938	505,867.02	0.16
126	300026	红日药业	28,700	499,093.00	0.16
127	300271	华宇软件	26,200	495,704.00	0.15
128	002664	信质电机	14,500	493,290.00	0.15
129	300036	超图软件	20,100	492,450.00	0.15
130	600688	上海石化	79,300	483,730.00	0.15
131	000040	东旭蓝天	41,100	482,514.00	0.15
132	002236	大华股份	36,800	482,080.00	0.15
133	002665	首航节能	61,050	481,684.50	0.15

134	600056	中国医药	30,300	480,558.00	0.15
135	603167	渤海轮渡	48,200	479,590.00	0.15
136	000970	中科三环	33,000	478,830.00	0.15
137	600436	片仔癀	10,500	472,605.00	0.15
138	000607	华媒控股	56,000	472,080.00	0.15
139	000963	华东医药	7,000	471,800.00	0.15
140	300383	光环新网	12,400	469,960.00	0.15
141	600595	中孚实业	83,300	469,812.00	0.15
142	600373	中文传媒	22,600	468,950.00	0.15
143	300124	汇川技术	24,099	467,520.60	0.15
144	002244	滨江集团	69,600	466,320.00	0.15
145	002053	云南盐化	16,400	465,596.00	0.15
146	002502	骅威文化	18,900	464,940.00	0.15
147	002361	神剑股份	59,900	464,824.00	0.14
148	300056	三维丝	25,600	462,080.00	0.14
149	600563	法拉电子	10,140	461,572.80	0.14
150	000967	盈峰环境	20,800	461,552.00	0.14
151	600998	九州通	26,269	459,970.19	0.14
152	300306	远方光电	19,359	459,389.07	0.14
153	002080	中材科技	22,800	457,824.00	0.14
154	002152	广电运通	27,750	456,210.00	0.14
155	300141	和顺电气	12,900	455,370.00	0.14
156	002714	牧原股份	9,000	454,770.00	0.14
157	600667	太极实业	45,400	453,546.00	0.14
158	002292	奥飞娱乐	15,100	452,245.00	0.14
159	000089	深圳机场	52,900	449,650.00	0.14
160	600529	山东药玻	25,400	447,294.00	0.14
161	300379	东方通	5,600	445,088.00	0.14
162	300200	高盟新材	27,300	444,990.00	0.14
163	600009	上海机场	17,000	442,850.00	0.14

164	600566	济川药业	17,200	442,728.00	0.14
165	300031	宝通科技	17,300	441,496.00	0.14
166	002364	中恒电气	16,000	438,880.00	0.14
167	000971	高升控股	17,600	438,592.00	0.14
168	002020	京新药业	35,200	435,424.00	0.14
169	002405	四维图新	17,700	435,420.00	0.14
170	002460	赣锋锂业	13,000	434,850.00	0.14
171	002308	威创股份	26,400	433,752.00	0.14
172	300251	光线传媒	37,500	433,500.00	0.14
173	300091	金通灵	29,700	433,323.00	0.14
174	002384	东山精密	21,800	432,948.00	0.14
175	600338	西藏珠峰	14,700	432,033.00	0.13
176	600382	广东明珠	27,000	432,000.00	0.13
177	002661	克明面业	26,300	431,583.00	0.13
178	000059	华锦股份	46,327	430,841.10	0.13
179	300049	福瑞股份	18,094	430,094.38	0.13
180	000807	云铝股份	65,500	429,025.00	0.13
181	600077	宋都股份	88,600	428,824.00	0.13
182	600180	瑞茂通	28,300	427,613.00	0.13
183	600068	葛洲坝	73,400	427,188.00	0.13
184	000150	宜华健康	13,700	427,166.00	0.13
185	002466	天齐锂业	10,000	426,900.00	0.13
186	000728	国元证券	25,500	426,360.00	0.13
187	600461	洪城水业	32,800	425,744.00	0.13
188	603368	柳州医药	4,900	425,418.00	0.13
189	300367	东方网力	17,100	424,593.00	0.13
190	000698	沈阳化工	64,200	419,868.00	0.13
191	600759	洲际油气	55,300	419,174.00	0.13
192	600114	东睦股份	24,900	418,569.00	0.13
193	300113	顺网科技	11,000	417,560.00	0.13

194	002081	金螳螂	41,600	416,832.00	0.13
195	002171	楚江新材	24,100	415,243.00	0.13
196	600771	广誉远	14,200	413,788.00	0.13
197	002215	诺普信	40,000	413,600.00	0.13
198	300261	雅本化学	33,980	413,536.60	0.13
199	600351	亚宝药业	40,900	410,227.00	0.13
200	000596	古井贡酒	8,500	407,575.00	0.13
201	300255	常山药业	49,100	407,530.00	0.13
202	600589	广东榕泰	40,000	406,000.00	0.13
203	002200	云投生态	21,500	405,490.00	0.13
204	300003	乐普医疗	22,200	404,928.00	0.13
205	002294	信立泰	14,800	402,560.00	0.13
206	000513	丽珠集团	8,700	401,157.00	0.13
207	002675	东诚药业	8,600	400,158.00	0.12
208	002138	顺络电子	22,000	398,860.00	0.12
209	000049	德赛电池	9,500	398,430.00	0.12
210	000028	国药一致	6,100	397,110.00	0.12
211	002463	沪电股份	75,000	396,000.00	0.12
212	603111	康尼机电	29,150	391,193.00	0.12
213	600782	新钢股份	72,700	387,491.00	0.12
214	600986	科达股份	24,200	386,716.00	0.12
215	300095	华伍股份	28,700	379,127.00	0.12
216	603338	浙江鼎力	8,220	378,942.00	0.12
217	002637	赞宇科技	30,100	377,755.00	0.12
218	600123	兰花科创	52,600	377,668.00	0.12
219	600276	恒瑞医药	9,400	377,034.00	0.12
220	002321	华英农业	40,000	376,800.00	0.12
221	002137	麦达数字	22,000	373,120.00	0.12
222	000759	中百集团	53,700	371,067.00	0.12
223	600755	厦门国贸	46,600	370,470.00	0.12

224	300246	宝莱特	12,200	369,782.00	0.12
225	002217	合力泰	23,800	364,140.00	0.11
226	002450	康得新	21,287	364,007.70	0.11
227	300070	碧水源	24,300	361,584.00	0.11
228	000839	中信国安	16,900	360,139.00	0.11
229	002188	巴士在线	12,300	355,839.00	0.11
230	300498	温氏股份	9,800	354,956.00	0.11
231	600138	中青旅	18,100	349,692.00	0.11
232	300215	电科院	26,900	346,472.00	0.11
233	002298	中电鑫龙	19,900	328,350.00	0.10
234	600201	生物股份	12,000	327,960.00	0.10
235	600195	中牧股份	17,600	322,080.00	0.10
236	600718	东软集团	16,900	309,608.00	0.10
237	002281	光迅科技	4,800	308,160.00	0.10
238	603609	禾丰牧业	19,400	307,102.00	0.10
239	300119	瑞普生物	18,800	301,740.00	0.09
240	601888	中国国旅	6,700	294,666.00	0.09
241	002039	黔源电力	15,300	294,219.00	0.09
242	000958	东方能源	20,000	277,000.00	0.09
243	002707	众信旅游	13,300	269,990.00	0.08
244	600859	王府井	17,670	269,290.80	0.08
245	002271	东方雨虹	15,500	267,065.00	0.08
246	300162	雷曼股份	11,800	259,482.00	0.08
247	600886	国投电力	38,800	256,080.00	0.08
248	000488	晨鸣纸业	31,900	253,286.00	0.08
249	600987	航民股份	20,100	243,612.00	0.08
250	600826	兰生股份	9,100	238,238.00	0.07
251	002503	搜于特	18,800	233,496.00	0.07
252	603898	好莱客	7,100	220,739.00	0.07
253	002235	安妮股份	12,100	220,341.00	0.07

254	002511	中顺洁柔	12,900	219,687.00	0.07
255	000793	华闻传媒	22,200	219,336.00	0.07
256	002243	通产丽星	16,500	210,375.00	0.07
257	600612	老凤祥	5,100	208,335.00	0.06
258	300345	红宇新材	16,340	170,916.40	0.05
259	000786	北新建材	17,500	158,900.00	0.05
260	600730	中国高科	11,100	156,843.00	0.05
261	002671	龙泉股份	11,400	140,790.00	0.04
262	002655	共达电声	8,400	135,660.00	0.04
263	002372	伟星新材	9,390	134,840.40	0.04
264	300166	东方国信	4,769	131,004.43	0.04
265	002465	海格通信	10,000	124,400.00	0.04
266	002318	久立特材	10,400	120,328.00	0.04
267	002443	金洲管道	8,100	116,235.00	0.04
268	601127	小康股份	4,428	105,696.36	0.03
269	002667	鞍重股份	2,300	70,127.00	0.02
270	002468	艾迪西	2,300	65,826.00	0.02
271	300518	盛讯达	1,287	60,295.95	0.02
272	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
273	601966	玲珑轮胎	2,575	33,423.50	0.01
274	000802	北京文化	1,200	28,224.00	0.01
275	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
276	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
277	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	—
278	300520	科大国创	926	9,306.30	—
279	002805	丰元股份	971	5,631.80	—

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601009	南京银行	8,297,752.70	2.59
2	002142	宁波银行	5,485,315.79	1.71
3	600705	中航资本	3,935,121.30	1.23
4	601318	中国平安	3,933,146.00	1.23
5	000001	平安银行	3,212,381.00	1.00
6	000666	经纬纺机	3,048,590.00	0.95
7	600000	浦发银行	2,797,077.00	0.87
8	601166	兴业银行	1,971,810.00	0.62
9	600999	招商证券	1,721,810.00	0.54
10	000166	申万宏源	1,721,254.00	0.54
11	600340	华夏幸福	1,687,342.00	0.53
12	600030	中信证券	1,681,368.00	0.52
13	601601	中国太保	1,663,341.74	0.52
14	601169	北京银行	1,662,322.00	0.52
15	002262	恩华药业	1,660,045.00	0.52
16	600038	中直股份	1,502,219.20	0.47
17	000563	陕国投 A	1,350,544.78	0.42
18	600885	宏发股份	1,349,511.67	0.42
19	002554	惠博普	1,304,117.00	0.41
20	600109	国金证券	1,270,123.00	0.40

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601288	农业银行	1,081,604.00	0.34
2	601988	中国银行	1,079,488.00	0.34
3	601939	建设银行	1,067,017.00	0.33

4	601998	中信银行	1,063,750.00	0.33
5	000001	平安银行	1,029,000.00	0.32
6	600016	民生银行	994,165.00	0.31
7	600429	三元股份	298,452.00	0.09
8	002151	北斗星通	277,553.00	0.09
9	600823	世茂股份	259,191.98	0.08
10	600657	信达地产	258,607.00	0.08
11	000418	小天鹅 A	236,128.00	0.07
12	600050	中国联通	230,442.00	0.07
13	600551	时代出版	228,144.00	0.07
14	600583	海油工程	224,260.00	0.07
15	300037	新宙邦	223,140.00	0.07
16	601179	中国西电	216,454.00	0.07
17	002726	龙大肉食	215,002.46	0.07
18	002467	二六三	213,741.00	0.07
19	600196	复星医药	210,543.00	0.07
20	601929	吉视传媒	207,218.00	0.06

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	198,467,468.63
卖出股票的收入（成交）总额	22,847,107.04

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,982,404.80	4.98
2	央行票据	—	—
3	金融债券	19,966,000.00	6.23

	其中：政策性金融债	19,966,000.00	6.23
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	21,350,000.00	6.66
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	57,298,404.80	17.87

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101453020	14南电 MTN002	200,000	21,350,000.00	6.66
2	160209	16国开09	200,000	19,966,000.00	6.23
3	019533	16国债05	159,920	15,982,404.80	4.98

注：本基金本报告期末只持有三只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1612	中证500股指期货1612合约	26	29,412,240.00	3,258,320.00	

7.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内，根据公募基金相关法规和本基金合同，我们可以使用股指期货代替一部分现货仓位。本报告期间，股指期货大幅贴水，我们选择保持一定比例的股指期货长仓，一方面获取比较确定的超额收益，另一方面提升组合流动性。

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投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

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没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有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	6,192,745.59
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	927,889.72
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,120,635.31

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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
322	961,505.77	300,007,989.04	96.90%	9,596,869.33	3.10%

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	9,986.81	0.0032%

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年4月26日)基金份额总额	309,604,858.37
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	—
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
基金合同生效日起至报告期期末期末基金份额总额	309,604,858.37

§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

(1) 基金管理人专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人于2016年5月10日发布公告，经泓德基金管理有限公司董事会审议，聘任温永鹏先生为公司副总经理。

公司已根据相关法律法规要求，在指定媒体公开披露了公司人员的变更信息，并已在监管机构备案。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期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

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	2	213,381,666.18	96.49%	151,777.08	95.54%	—
中信建投证券	2	7,767,858.96	3.51%	7,079.16	4.46%	—
安信证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	2	—	—	—	—	—
首创证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券	2	—	—	—	—	—
长江证券	1	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
海通证券	1	—	—	—	—	—

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比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
平安证券	—	—	3,162,100,000	91.33%	—	—
中信建投证券	15,999,458.5	100%	300,000,000	8.67%	—	—

安信证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
首创证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源证 券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需
要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究部、投资部等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每季度对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

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	泓德基金关于参加浙江同花顺基	公司官网、中国证券报	2016-01-08

	金销售有限公司费率优惠活动的公告		
2	泓德泓益量化混合型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、中国证券报	2016-03-21
3	泓德基金管理有限公司关于泓德泓益量化混合型证券投资基金实行公司直销渠道认购费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-23
4	泓德基金管理有限公司关于泓德泓益量化混合型证券投资基金新增销售机构的公告	公司官网、中国证券报	2016-03-28
5	关于泓德泓益量化混合型证券投资基金新增中国银河证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-13
6	关于旗下基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-14
7	关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-21
8	泓德泓益量化混合型证券投资基金合同生效公告	公司官网、中国证券报	2016-04-27
9	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金通过直销柜台向养老金客户实施特定费率的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-27
10	泓德泓益量化混合型证券投资基金增聘基金经理公告	公司官网、中国证券报	2016-04-28
11	关于旗下基金增加平安证券有限责任公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-04-28
12	关于旗下基金增加诺亚正行（上	公司官网、中国证券报	2016-05-16

	海)基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投业务并参与其费率优惠的公告		
13	关于旗下基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
14	关于旗下基金增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
15	关于旗下基金增加珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-05-16
16	关于旗下基金增加北京创金启富投资管理有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25
17	关于旗下基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠的公告	公司官网、中国证券报	2016-06-25

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证券监督管理委员会批准泓德泓益量化混合型证券投资基金设立的文件
- (2) 《泓德泓益量化混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《泓德泓益量化混合型证券投资基金托管协议》
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 泓德泓益量化混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处

11.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- (3) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司

二〇一六年八月二十七日