

建信精工制造指数增强型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 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。

基金托管人中信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
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	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	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
§5 托管人报告	13
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
§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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 备查文件目录.....	50
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	51
11.3 查阅方式.....	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信精工制造指数增强型证券投资基金
基金简称	建信精工制造指数增强
基金主代码	001397
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 8 月 26 日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	96,844,478.27 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对中证精工制造指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证精工制造指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长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 0.5%，年跟踪误差不超过 8%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	90%×中证精工制造指数收益率+10%×商业银行活期存款利率（税前）。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种。

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		建信基金管理有限责任公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	方韡
	联系电话	010-66228888	010-89936330
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	fangwei@citicbank.com.cn

客户服务电话	400-81-95533 010-66228000	95558
传真	010-66228001	010-85230024
注册地址	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码	100033	100010
法定代表人	许会斌	常振明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
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	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16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 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-15,171,697.95
本期利润	-15,371,701.78
加权平均基金份额本期利润	-0.1455
本期加权平均净值利润率	-16.61%
本期基金份额净值增长率	-11.95%
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	-6,539,898.65
期末可供分配基金份额利润	-0.0675
期末基金资产净值	90,304,579.62
期末基金份额净值	0.9325
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	-6.75%
-------------	--------

注：1、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。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果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（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

3.2 基金净值表现

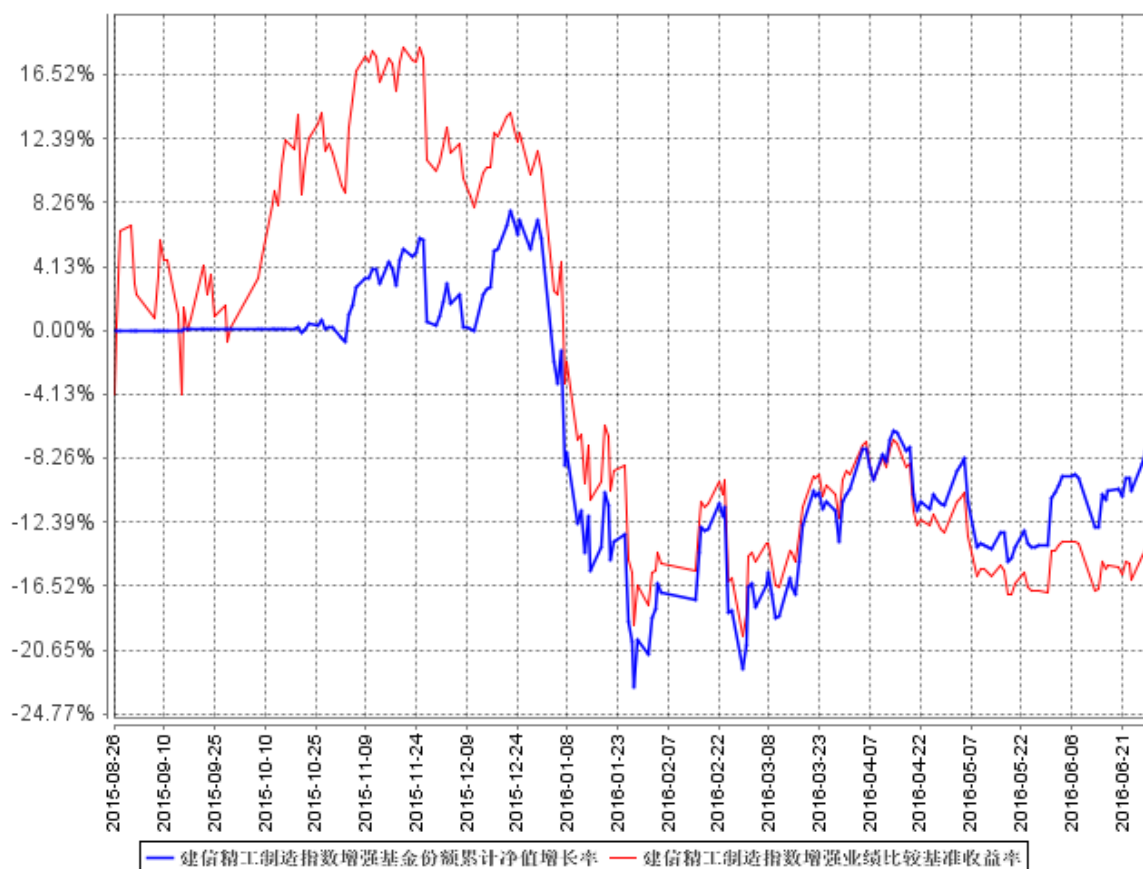
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.53%	1.18%	0.68%	1.13%	3.85%	0.05%
过去三个月	4.34%	1.35%	-5.04%	1.26%	9.38%	0.09%
过去六个月	-11.95%	2.26%	-21.88%	2.14%	9.93%	0.12%
自基金合同生效起至今	-6.75%	1.83%	-13.71%	2.13%	6.96%	-0.30%

注：本基金业绩比较基准为 $90\% \times \text{中证精工制造指数收益率} + 10\% \times \text{商业银行活期存款利率（税前）}$ 。本基金为指数增强型基金，持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。故在业绩比较基准中给予标的指数收益率 90% 的权重，相应将 10% 作为体现现金或到期日在一年以内的政府债券业绩表现的权重。中证精工制造指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，涵盖工业和通信设备行业，综合反映了这两个行业的上市公司的整体情况。

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

建信精工制造指数增强基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2015 年 8 月 26 日生效，截至报告期末未满一年。

2、本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

§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

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、量化衍生品及海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务

部、网络金融部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司和华东、西北两个营销中心，设立了子公司——建信资本管理有限责任公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“国际一流、国内领先的综合性资产管理公司”。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值混合型证券投资基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）、建信创新中国混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金、建信全球机遇混合型证券投资基金、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信全球资源混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信消费升级混合型证券投资基金、建信安心保本混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信双周安心理财债券型证券投资基金、建信月盈安心理财债券型证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信回报灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫丰回报灵活配置混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信中证互联网金融指数分级发起式证券投资基金、建信中证申万有色金属指数分级发起式证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信安心保本二号混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型

证券投资基金、建信安心保本三号混合型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、建信目标收益一年期债券型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信安心保本六号混合型证券投资基金、建信鑫盛回报灵活配置混合型证券投资基金、建信安心保本七号混合型证券投资基金，共计 68 只开放式基金，管理的基金净资产规模共计为 2,453.84 亿元。

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		
叶乐天	金融工程及指数投资部总经理助理、本基金的基金经理	2015 年 8 月 26 日	—	8	硕士。曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理，从事风险模型、量化研究与投资；2011 年 9 月加入我公司，担任基金经理助理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任中证 500 指数增强基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在

认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

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

本基金管理人以量化分析研究为基础，利用量化模型进行指数增强和风险管理，在上半年市场波动较大的情况下，坚持量化增强策略，并获得了较为显著且稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金净值增长率-11.95%，波动率 2.26%，业绩比较基准收益率-21.88%，波动率 2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

股票价格由上市公司赢利水平及估值水平这两方面决定。从上半年公布的宏观经济数据及上市公司的财报来看，上市公司赢利水平并没有明显的变化，宏观经济总体还处在“L”型走势的底部。从估值水平方面来看，流动性支撑了估值水平的下限，风险偏好制约了估值水平的上限。因此总体来说，今年下半年预计指数仍将维持震荡的走势。在这种行情下，精选个股尤为重要，需密切关注上市公司的半年报以及所在行业的成长性。

本基金管理人将坚持量化分析研究，进一步改进指数增强策略，努力克服市场的波动，持续

获取稳健的超额收益。

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，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总裁、督察长、投资总经理、研究总经理、风险管理总经理、运营总经理及监察稽核总经理组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不适用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金）。

自 2015 年 3 月 26 日起，公司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价格，对公司旗下基金持有的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）进行估值。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

自 2015 年 8 月 26 日建信精工制造指数增强型证券投资基金（以下称“建信精工制造指数增强”或“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——建信基金管理有限责任公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本基金本年度无分红。

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

由建信精工制造指数增强型证券投资基金管理人——建信基金管理有限责任公司编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金
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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	11,108,210.33	13,245,828.59
结算备付金		1,661,032.45	5,584,366.17
存出保证金		1,880,338.21	2,524,786.59

交易性金融资产	6.4.7.2	76,615,008.00	100,255,749.60
其中：股票投资		73,615,308.00	97,032,427.30
基金投资		-	-
债券投资		2,999,700.00	3,223,322.30
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		-	1,661,472.39
应收利息	6.4.7.5	59,150.73	189,091.56
应收股利		-	-
应收申购款		24,101.10	15,106.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		91,347,840.82	123,476,401.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		384.32	-
应付赎回款		146,320.23	1,437,718.47
应付管理人报酬		72,045.35	110,343.70
应付托管费		14,409.03	22,068.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	470,686.68	222,355.78
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	339,415.59	148,635.40
负债合计		1,043,261.20	1,941,122.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	96,844,478.27	114,758,724.64
未分配利润	6.4.7.10	-6,539,898.65	6,776,554.90
所有者权益合计		90,304,579.62	121,535,279.54
负债和所有者权益总计		91,347,840.82	123,476,401.63

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9325 元，基金份额总额 96,844,478.27 份。

6.2 利润表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

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		-13,766,131.99	-
1.利息收入		71,897.12	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,713.21	-
债券利息收入		37,892.24	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,291.67	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,677,613.22	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-12,202,672.23	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-38,703.50	-
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	-1,747,080.00	-
股利收益	6.4.7.16	310,842.51	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-200,003.83	-
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	39,587.94	-
减：二、费用		1,605,569.79	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	461,942.34	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	92,388.43	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	759,442.19	-
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	291,796.83	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,371,701.78	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,371,701.78	-

注：本基金基金合同自 2015 年 8 月 26 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信精工制造指数增强型证券投资基金

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）	114,758,724.64	6,776,554.90	121,535,279.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,371,701.78	-15,371,701.78
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）	-17,914,246.37	2,055,248.23	-15,858,998.14
其中：1.基金申购款	5,298,227.99	-611,403.50	4,686,824.49
2.基金赎回款	-23,212,474.36	2,666,651.73	-20,545,822.63
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）	96,844,478.27	-6,539,898.65	90,304,579.62
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）	-	-	-

注：本基金基金合同自 2015 年 8 月 26 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

<u>孙志晨</u>	<u>赵乐峰</u>	<u>丁颖</u>
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

建信精工制造指数增强型证券投资基金(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[2015]285 号《关于准予建信精工制造指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信精工制造指数增强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 241,071,727.57 元，业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(2015)第 972 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》于 2015 年 8 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 241,172,123.23 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,395.66 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为：本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%；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，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为 90% X 中证精工制造指数收益率+10% X 商业银行活期存款利率(税前)。

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》、《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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 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等有关信息。

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

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

本基金本报告期内未发生会计差错。

6.4.6 税项

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[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融

机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 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。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	11,108,210.33
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	11,108,210.33

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	75,407,648.99	73,615,308.00	-1,792,340.99
贵金属投资-金交所	—	—	—

黄金合约				
债券	交易所市场	3,002,205.60	2,999,700.00	-2,505.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,002,205.60	2,999,700.00	-2,505.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		78,409,854.59	76,615,008.00	-1,794,846.59

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			
	合同/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	8,164,160.00	-	-	
其中股指期货投资	8,164,160.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	8,164,160.00	-	-	

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）：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1607	中证 500 股指期货 IC1607 合约	7	8,460,760.00	296,600.00
总额合计	-	-	-	296,600.00
减：可抵销期 货暂收款	-	-	-	296,600.00
期货投资净额	-	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末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

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

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	890.22
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	515.28
应收债券利息	57,698.63
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	46.60
合计	59,150.73

6.4.7.6 其他资产

注：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	470,686.68
银行间市场应付交易费用	—
合计	470,686.68

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	402.21
预提费用	239,013.38
应付指数使用费	100,000.00
—	—
合计	339,415.59

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	114,758,724.64	114,758,724.64
本期申购	5,298,227.99	5,298,227.99
本期赎回(以“-”号填列)	-23,212,474.36	-23,212,474.36
— 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	96,844,478.27	96,844,478.27

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,348,344.70	-2,571,789.80	6,776,554.90
本期利润	-15,171,697.95	-200,003.83	-15,371,701.78
本期基金份额交易产生的变动数	964,951.69	1,090,296.54	2,055,248.23
其中：基金申购款	-104,878.71	-506,524.79	-611,403.50
基金赎回款	1,069,830.40	1,596,821.33	2,666,651.73
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-4,858,401.56	-1,681,497.09	-6,539,898.65

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	15,449.50
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	16,491.74
其他	771.97
合计	32,713.21

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	252,080,539.99
减：卖出股票成本总额	264,283,212.22
买卖股票差价收入	-12,202,672.23

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**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-38,703.50
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-38,703.50

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,431,895.09
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,260,703.50
减：应收利息总额	209,895.09
买卖债券差价收入	-38,703.50

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资-申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金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**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期末投资贵金属。

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**

本基金本报告期无衍生工具收益。

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
股指期货投资收益	-1,747,080.00

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	310,842.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	310,842.51

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	-641,003.83
——股票投资	-674,409.03
——债券投资	33,405.20
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	441,000.00
——权证投资	-
股指期货投资	441,000.00
3. 其他	-
合计	-200,003.83

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	38,011.33
转换费收入	1,576.61
合计	39,587.94

注：1、基金的场外赎回费率按持有期间递减，对于持有期少于 30 日的基金份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 75%归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 50%归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的基金份额所收取的赎回费，赎回费用 25%归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中对于持有期少于 30 日的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用全额归入基金财产；对于持有期长于 30 日但少于 3 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 75%归入基金财产；对于持有期长于 3 个月但小于 6 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 50%归入基金财产；对于持有期长于 6 个月的转出基金份额所收取的赎回费，将赎回费用 25%归入基金财产。

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	750,311.77
银行间市场交易费用	—
股指期货交易费用	9,130.42
合计	759,442.19

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	29,835.26
信息披露费	149,178.12
指数使用费	100,000.00
其他费用	4,500.00
银行费用	8,283.45
合计	291,796.83

6.4.7.21 分部报告

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东

建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司
--------------	-----------

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

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易，本基金合同生效日为 2015 年 8 月 26 日，无上年度可比区间。

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

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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 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	461,942.34	-
其中：支付销售机构的客户维护费	232,148.14	-

注：1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司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。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中

列支的费用项目。

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	92,388.43	-

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

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

本基金本报告期未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（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

本基金本报告期未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金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 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
中信银行	11,108,210.33	15,449.50	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016 年 6 月 24 日	2016 年 7 月 6 日	新发未上市	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新发未上市	8.49	8.49	718	6,095.82	6,095.82	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新发未上市	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新发未上市	10.05	10.05	536	5,386.80	5,386.80	-

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
002465	海格通信	2016 年 6 月 13 日	重大事项	12.44	-	-	156,100	2,016,880.40	1,941,884.00	-
300292	吴通控股	2016 年 1 月 25 日	重大事项	33.26	2016 年 7 月 20 日	36.48	33,476	1,412,281.43	1,113,411.76	-
000547	航天发展	2016 年	重大资产	15.36	-	-	71,600	1,007,404.57	1,099,776.00	-

		4 月 19 日	重组							
300299	富春 通信	2016 年 2 月 29 日	重大 资产 重组	27.51	-	-	22,500	964,369.71	618,975.00	-
600848	上海 临港	2016 年 3 月 16 日	重大 资产 重组	15.42	2016 年 7 月 6 日	16.96	37,400	714,746.47	576,708.00	-
300345	红宇 新材	2016 年 6 月 21 日	重大 事项	10.46	2016 年 7 月 19 日	11.46	14,600	144,784.30	152,716.00	-
002654	万润 科技	2016 年 5 月 9 日	重大 事项	15.57	-	-	8,600	119,186.00	133,902.00	-
300338	开元 仪器	2016 年 4 月 15 日	重大 资产 重组	18.20	-	-	5,400	95,352.50	98,280.00	-
300298	三诺 生物	2016 年 3 月 21 日	重大 资产 重组	20.96	2016 年 8 月 4 日	23.06	4,550	95,614.00	95,368.00	-
002452	长高 集团	2016 年 6 月 14 日	重大 事项	12.02	2016 年 7 月 12 日	10.82	7,800	84,196.46	93,756.00	-
002355	兴民 智通	2016 年 5 月 12 日	重大 资产 重组	19.35	-	-	4,500	84,183.99	87,075.00	-
002266	浙富 控股	2016 年 5 月 25 日	重大 事项	5.35	-	-	16,000	98,372.00	85,600.00	-
600654	中安 消	2016 年 5 月 19 日	重大 资产 重组	18.54	2016 年 8 月 8 日	20.39	4,500	87,098.00	83,430.00	-
600734	实达 集团	2016 年	重大 资产	14.60	-	-	4,800	65,451.00	70,080.00	-

		4 月 20 日	重组							
002101	广东 鸿图	2016 年 5 月 3 日	重大 资产 重组	21.62	-	-	1,050	10,038.00	22,701.00	-
300450	先导 智能	2016 年 3 月 14 日	重大 资产 重组	37.81	2016 年 7 月 20 日	41.59	600	17,651.85	22,686.00	-
000415	渤海 金控	2016 年 2 月 1 日	重大 资产 重组	6.82	2016 年 08 月 11 日	7.50	300	2,612.65	2,046.00	-

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

本报告期末，本基金银行间市场无债券正回购交易余额，故未存在作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易，故未存在作为抵押的债券。

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涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，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对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、
监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的
督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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同责任，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帐户，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。在定期存款和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产品投资流程，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。按信用评级列示的债券投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年末未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

无

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，本基金所承担的其他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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资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现金流量在很大程度上独立于市场利率变化，本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	11,108,210.33	-	-	-	11,108,210.33
结算备付金	1,661,032.45	-	-	-	1,661,032.45
存出保证金	1,880,338.21	-	-	-	1,880,338.21
交易性金融资产	2,999,700.00	-	-	-73,615,308.00	76,615,008.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	59,150.73	59,150.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,101.10	24,101.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,649,280.99	-	-	-73,698,559.83	91,347,840.82

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	384.32	384.32
应付赎回款	-	-	-	146,320.23	146,320.23
应付管理人报酬	-	-	-	72,045.35	72,045.35
应付托管费	-	-	-	14,409.03	14,409.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	470,686.68	470,686.68
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	339,415.59	339,415.59
负债总计	-	-	-	1,043,261.20	1,043,261.20
利率敏感度缺口	17,649,280.99	-	-	-72,655,298.63	90,304,579.62
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,245,828.59	-	-	-	13,245,828.59
结算备付金	5,584,366.17	-	-	-	5,584,366.17
存出保证金	2,524,786.59	-	-	-	2,524,786.59
交易性金融资产	3,223,322.30	-	-	-97,032,427.30	100,255,749.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,661,472.39	1,661,472.39
应收利息	-	-	-	189,091.56	189,091.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	15,106.73	15,106.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,578,303.65	-	-	-98,898,097.98	123,476,401.63
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,437,718.47	1,437,718.47
应付管理人报酬	-	-	-	110,343.70	110,343.70
应付托管费	-	-	-	22,068.74	22,068.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	222,355.78	222,355.78
应交税费	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	148,635.40	148,635.40
负债总计	-	-	-	1,941,122.09	1,941,122.09
利率敏感度缺口	24,578,303.65	-	-	-96,956,975.89	121,535,279.54

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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）
	市场利率上升25个基点	-838.18	-80.48
	市场利率下降25个基点	838.65	80.68

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，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，采用“自上而下”的策略，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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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的相关规定）。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。

本基金持有的股票市值和买入、卖出期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 80%；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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资股指期货以套期保值为目的，股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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，及时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		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	73,615,308.00	81.52	97,032,427.30	79.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,999,700.00	3.32	3,223,322.30	2.65
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	76,615,008.00	84.84	100,255,749.60	82.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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%	0.00	0.00
	业绩比较基准下降 5%	0.00	0.00

注：于本期末，本基金成立不满一年，尚无足够经验数据。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无

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 6 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级的余额为 67,100,672.64 元，属于第二层级的余额为 9,514,335.36 元，无属于第三层级的余额。于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(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。

(iv) 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 6 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	73,615,308.00	80.59
	其中：股票	73,615,308.00	80.59
2	固定收益投资	2,999,700.00	3.28
	其中：债券	2,999,700.00	3.28
	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	12,769,242.78	13.98
7	其他各项资产	1,963,590.04	2.15
8	合计	91,347,840.82	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	19,863,635.36	22.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	5,944,835.53	6.58
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	4,760,195.00	5.27
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	913,171.00	1.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	686,790.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,168,626.89	35.62

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 期末积极投资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	504,712.00	0.56
B	采掘业	540,060.00	0.60
C	制造业	32,088,968.94	35.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	464,700.00	0.51
E	建筑业	177,527.80	0.20
F	批发和零售业	1,178,095.89	1.30
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	2,310,686.38	2.56
J	金融业	1,050,255.00	1.16
K	房地产业	1,714,995.00	1.90
L	租赁和商务服务业	1,126,348.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.02
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	270,206.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	41,446,681.11	45.90

注：以上行业分类以 2016 年 6 月 30 日的中国证监会行业分类标准为依据。

7.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末投资沪港通股票。

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

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	600835	上海机电	168,900	3,241,191.00	3.59
2	601390	中国中铁	393,900	2,745,483.00	3.04
3	600031	三一重工	458,300	2,300,666.00	2.55
4	601766	中国中车	236,500	2,168,705.00	2.40
5	002465	海格通信	156,100	1,941,884.00	2.15
6	600320	振华重工	380,200	1,615,850.00	1.79
7	601186	中国铁建	156,395	1,557,694.20	1.72
8	002202	金风科技	101,500	1,535,695.00	1.70
9	000768	中航飞机	68,900	1,356,641.00	1.50
10	601800	中国交建	113,600	1,196,208.00	1.32
11	000547	航天发展	71,600	1,099,776.00	1.22
12	601111	中国国航	147,000	993,720.00	1.10
13	600406	国电南瑞	68,300	913,171.00	1.01
14	300001	特锐德	41,000	889,290.00	0.98
15	600685	中船防务	33,700	854,632.00	0.95
16	600020	中原高速	185,000	817,700.00	0.91
17	300156	神雾环保	37,642	774,672.36	0.86
18	600026	中海发展	130,500	769,950.00	0.85
19	600415	小商品城	110,800	684,744.00	0.76
20	601018	宁波港	114,800	568,260.00	0.63
21	600270	外运发展	32,400	566,676.00	0.63
22	600517	置信电气	53,100	504,981.00	0.56
23	600009	上海机场	15,700	408,985.00	0.45
24	000088	盐田港	52,900	340,676.00	0.38
25	601886	江河集团	30,579	314,046.33	0.35
26	000738	中航动控	11,800	311,520.00	0.34
27	600787	中储股份	39,600	294,228.00	0.33
28	002176	江特电机	15,000	231,000.00	0.26
29	601727	上海电气	25,100	189,756.00	0.21
30	002123	荣信股份	8,000	166,320.00	0.18
31	601608	中信重工	30,400	163,248.00	0.18
32	601989	中国重工	25,600	162,048.00	0.18

33	601668	中国建筑	24,700	131,404.00	0.15
34	600089	特变电工	15,400	131,208.00	0.15
35	600487	亨通光电	7,000	88,060.00	0.10
36	002266	浙富控股	16,000	85,600.00	0.09
37	002013	中航机电	1,950	26,286.00	0.03
38	603699	纽威股份	1,300	23,062.00	0.03
39	000415	渤海金控	300	2,046.00	0.00
40	000400	许继电气	100	1,544.00	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

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	002493	荣盛石化	121,200	1,468,944.00	1.63
2	000657	中钨高新	81,400	1,233,210.00	1.37
3	002286	保龄宝	78,100	1,169,938.00	1.30
4	000561	烽火电子	104,019	1,156,691.28	1.28
5	002188	巴士在线	38,900	1,125,377.00	1.25
6	000587	金洲慈航	72,800	1,123,304.00	1.24
7	300292	吴通控股	33,476	1,113,411.76	1.23
8	002668	奥马电器	17,400	1,059,138.00	1.17
9	002243	通产丽星	79,100	1,008,525.00	1.12
10	002487	大金重工	112,000	991,200.00	1.10
11	002236	大华股份	72,100	944,510.00	1.05
12	300272	开能环保	53,654	827,881.22	0.92
13	002594	比亚迪	13,000	793,130.00	0.88
14	002142	宁波银行	46,100	681,358.00	0.75
15	300287	飞利信	50,700	679,380.00	0.75
16	000858	五粮液	19,800	644,094.00	0.71
17	000031	中粮地产	66,300	625,209.00	0.69
18	300299	富春通信	22,500	618,975.00	0.69
19	000599	青岛双星	88,100	606,128.00	0.67
20	600848	上海临港	37,400	576,708.00	0.64
21	002036	联创电子	22,000	515,020.00	0.57
22	600818	中路股份	16,500	513,315.00	0.57
23	002137	麦达数字	29,200	495,232.00	0.55
24	002322	理工环科	26,100	494,334.00	0.55
25	000036	华联控股	59,000	484,390.00	0.54

26	601216	君正集团	63,100	471,357.00	0.52
27	000967	盈峰环境	19,665	436,366.35	0.48
28	600366	宁波韵升	17,800	424,886.00	0.47
29	600559	老白干酒	17,250	413,310.00	0.46
30	000422	湖北宜化	67,500	412,425.00	0.46
31	603288	海天味业	13,300	404,320.00	0.45
32	600963	岳阳林纸	65,550	401,166.00	0.44
33	000716	黑芝麻	57,100	385,996.00	0.43
34	600015	华夏银行	37,300	368,897.00	0.41
35	000488	晨鸣纸业	45,800	363,652.00	0.40
36	002696	百洋股份	18,800	359,832.00	0.40
37	002333	罗普斯金	36,100	351,614.00	0.39
38	002483	润邦股份	29,300	338,122.00	0.37
39	300406	九强生物	15,600	334,620.00	0.37
40	002614	蒙发利	27,600	331,476.00	0.37
41	002166	莱茵生物	29,000	331,470.00	0.37
42	002468	艾迪西	11,400	326,268.00	0.36
43	601012	隆基股份	24,300	317,115.00	0.35
44	002660	茂硕电源	20,500	308,935.00	0.34
45	600409	三友化工	45,300	305,322.00	0.34
46	000722	湖南发展	22,000	304,260.00	0.34
47	002534	杭锅股份	28,400	302,460.00	0.33
48	601898	中煤能源	57,500	296,700.00	0.33
49	601238	广汽集团	12,300	288,927.00	0.32
50	002124	天邦股份	27,100	288,615.00	0.32
51	002221	东华能源	23,600	287,684.00	0.32
52	000066	长城电脑	22,400	285,600.00	0.32
53	603366	日出东方	33,000	277,200.00	0.31
54	002426	胜利精密	27,000	265,950.00	0.29
55	002005	德豪润达	43,300	255,903.00	0.28
56	000701	厦门信达	14,100	248,583.00	0.28
57	002554	惠博普	33,800	243,360.00	0.27
58	002011	盾安环境	21,200	239,136.00	0.26
59	600590	泰豪科技	17,700	238,242.00	0.26
60	002394	联发股份	15,700	237,070.00	0.26
61	300271	华宇软件	12,200	230,824.00	0.26
62	002466	天齐锂业	5,400	230,526.00	0.26
63	002179	中航光电	5,200	225,264.00	0.25
64	002661	克明面业	13,700	224,817.00	0.25

65	002197	证通电子	11,100	213,342.00	0.24
66	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.23
67	300252	金信诺	6,218	206,002.34	0.23
68	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.22
69	600186	莲花健康	36,700	194,877.00	0.22
70	300031	宝通科技	7,300	186,296.00	0.21
71	300182	捷成股份	10,800	184,788.00	0.20
72	002295	精艺股份	11,700	183,690.00	0.20
73	000032	深桑达 A	11,880	181,645.20	0.20
74	002382	蓝帆医疗	16,100	180,964.00	0.20
75	300231	银信科技	9,767	180,103.48	0.20
76	002624	完美世界	4,700	177,425.00	0.20
77	000501	鄂武商 A	11,301	177,312.69	0.20
78	002516	旷达科技	29,300	176,679.00	0.20
79	002006	精功科技	12,600	170,478.00	0.19
80	600617	国新能源	14,000	160,440.00	0.18
81	002597	金禾实业	11,800	158,946.00	0.18
82	300345	红宇新材	14,600	152,716.00	0.17
83	300498	温氏股份	4,000	144,880.00	0.16
84	300471	厚普股份	2,800	133,952.00	0.15
85	002654	万润科技	8,600	133,902.00	0.15
86	601933	永辉超市	32,200	132,986.00	0.15
87	002536	西泵股份	8,600	129,774.00	0.14
88	002304	洋河股份	1,800	129,456.00	0.14
89	300160	秀强股份	10,000	128,700.00	0.14
90	002247	帝龙新材	8,500	126,395.00	0.14
91	300221	银禧科技	6,000	122,520.00	0.14
92	300389	艾比森	4,900	120,393.00	0.13
93	002606	大连电瓷	6,000	116,940.00	0.13
94	002690	美亚光电	4,800	110,592.00	0.12
95	002329	皇氏集团	6,600	98,934.00	0.11
96	300338	开元仪器	5,400	98,280.00	0.11
97	300303	聚飞光电	10,199	96,992.49	0.11
98	002088	鲁阳节能	6,200	96,472.00	0.11
99	002581	未名医药	3,500	95,375.00	0.11
100	300298	三诺生物	4,550	95,368.00	0.11
101	002452	长高集团	7,800	93,756.00	0.10
102	300148	天舟文化	6,100	92,781.00	0.10
103	002421	达实智能	5,300	92,591.00	0.10

104	002078	太阳纸业	18,900	92,232.00	0.10
105	300121	阳谷华泰	6,700	91,723.00	0.10
106	601567	三星医疗	6,200	91,450.00	0.10
107	002659	中泰桥梁	5,000	90,300.00	0.10
108	300339	润和软件	2,500	89,600.00	0.10
109	002616	长青集团	4,300	89,010.00	0.10
110	002196	方正电机	2,600	88,894.00	0.10
111	002553	南方轴承	6,300	88,767.00	0.10
112	600075	新疆天业	7,700	88,627.00	0.10
113	002475	立讯精密	4,500	88,425.00	0.10
114	600477	杭萧钢构	12,790	87,227.80	0.10
115	002355	兴民智通	4,500	87,075.00	0.10
116	002415	海康威视	4,050	86,913.00	0.10
117	300367	东方网力	3,500	86,905.00	0.10
118	002743	富煌钢构	6,000	86,520.00	0.10
119	300302	同有科技	2,600	84,422.00	0.09
120	002281	光迅科技	1,300	83,460.00	0.09
121	600654	中安消	4,500	83,430.00	0.09
122	000703	恒逸石化	8,400	82,908.00	0.09
123	600693	东百集团	11,700	78,624.00	0.09
124	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.08
125	600734	实达集团	4,800	70,080.00	0.08
126	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.07
127	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.07
128	000678	襄阳轴承	6,300	49,770.00	0.06
129	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.05
130	600213	亚星客车	2,800	35,728.00	0.04
131	300306	远方光电	1,500	35,595.00	0.04
132	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.04
133	600438	通威股份	4,500	28,620.00	0.03
134	300247	乐金健康	3,300	27,390.00	0.03
135	600077	宋都股份	5,400	26,136.00	0.03
136	601616	广电电气	4,600	26,036.00	0.03
137	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.03
138	002101	广东鸿图	1,050	22,701.00	0.03
139	300450	先导智能	600	22,686.00	0.03
140	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.02
141	603016	新宏泰	718	6,095.82	0.01
142	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.01

143	300520	科大国创	536	5,386.80	0.01
144	002001	新 和 成	200	4,226.00	0.00
145	002795	永和智控	50	3,404.00	0.00
146	600048	保利地产	200	1,726.00	0.00
147	002601	佰利联	100	1,395.00	0.00
148	002637	赞宇科技	100	1,255.00	0.00
149	300131	英唐智控	100	1,181.00	0.00
150	002604	龙力生物	100	1,079.00	0.00
151	300058	蓝色光标	100	971.00	0.00
152	002003	伟星股份	56	875.28	0.00
153	000413	东旭光电	100	859.00	0.00
154	002092	中泰化学	100	846.00	0.00
155	002016	世荣兆业	100	826.00	0.00
156	300337	银邦股份	100	787.00	0.00
157	002302	西部建设	100	722.00	0.00
158	002701	奥瑞金	17	150.11	0.00
159	002570	贝因美	10	127.90	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	600026	中海发展	4,246,631.00	3.49
2	002465	海格通信	4,231,165.90	3.48
3	601618	中国中冶	4,203,599.00	3.46
4	601989	中国重工	3,484,579.63	2.87
5	601111	中国国航	3,431,680.50	2.82
6	000901	航天科技	3,130,267.00	2.58
7	600835	上海机电	2,944,889.09	2.42
8	000917	电广传媒	2,843,071.49	2.34
9	002123	荣信股份	2,715,359.68	2.23
10	002196	方正电机	2,645,629.00	2.18
11	600372	中航电子	2,457,532.00	2.02
12	600031	三一重工	2,437,032.00	2.01

13	002583	海能达	2,435,640.80	2.00
14	002498	汉缆股份	2,286,541.75	1.88
15	002487	大金重工	2,282,034.89	1.88
16	300156	神雾环保	2,128,638.48	1.75
17	601766	中国中车	2,028,173.00	1.67
18	601390	中国中铁	2,018,068.00	1.66
19	601258	庞大集团	1,966,808.00	1.62
20	000778	新兴铸管	1,897,176.00	1.56

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	601618	中国中冶	4,280,315.00	3.52
2	601766	中国中车	4,211,207.00	3.47
3	002074	国轩高科	3,799,409.00	3.13
4	601872	招商轮船	3,738,538.00	3.08
5	601989	中国重工	3,604,852.00	2.97
6	601669	中国电建	3,504,416.60	2.88
7	000901	航天科技	3,430,800.74	2.82
8	600026	中海发展	3,197,563.04	2.63
9	002179	中航光电	3,009,263.61	2.48
10	002196	方正电机	2,944,169.00	2.42
11	002123	荣信股份	2,885,562.00	2.37
12	002111	威海广泰	2,876,869.77	2.37
13	300156	神雾环保	2,851,056.52	2.35
14	000917	电广传媒	2,745,621.00	2.26
15	600029	南方航空	2,711,418.12	2.23
16	600686	金龙汽车	2,708,914.14	2.23
17	600372	中航电子	2,634,953.00	2.17
18	002221	东华能源	2,564,959.00	2.11
19	601111	中国国航	2,541,238.00	2.09
20	002583	海能达	2,375,778.61	1.95

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	241,506,266.25
卖出股票收入（成交）总额	252,080,539.99

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	2,999,700.00	3.32
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	2,999,700.00	3.32

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	019518	15 国债 18	30,000	2,999,700.00	3.32

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**

代码	名称	持仓量（买/卖）（手）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1607	IC1607	7	8,460,760.00	296,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					296,600.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,747,080.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					441,000.00

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将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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	1,880,338.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	59,150.73
5	应收申购款	24,101.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,963,590.04

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	1,941,884.00	2.15	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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

2,919	33,177.28	-	-	96,844,478.27	100.00%
-------	-----------	---	---	---------------	---------

8.2 期末上市基金前十名持有人

无

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	142,583.04	0.15%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年8月26日）基金份额总额	241,172,123.23
本报告期期初基金份额总额	114,758,724.64
本报告期基金总申购份额	5,298,227.99
减:本报告期基金总赎回份额	23,212,474.36
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	96,844,478.27

注：上述总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	277,424,769.48	56.37%	258,366.97	56.84%	-
广证恒生	1	178,544,227.67	36.28%	162,707.59	35.79%	-
东北证券	1	23,556,371.74	4.79%	21,938.24	4.83%	-
招商证券	1	12,666,025.25	2.57%	11,547.41	2.54%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制

定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为。

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务。

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本报告期新增招商证券和东北证券各一个席位单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

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
方正证券	-	-	-	-	-	-
广证恒生	7,069,428.87	100.00%	5,000,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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	关于新增平安证券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016年6月3日
2	关于新增上海长量为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016年5月25日

3	建信基金管理有限责任公司关于北京汇成基金销售有限公司为旗下代销机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 5 月 25 日
4	建信基金管理有限责任公司关于新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 4 月 15 日
5	关于新增中信期货为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2016 年 2 月 5 日

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信精工制造指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信精工制造指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信精工制造指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信精工制造指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 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、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2016 年 8 月 27 日