

**国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)**

**2016年年度报告**

**2016年12月31日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月24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。

本报告中的财务资料经审计，毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	6
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 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	15
6.1 管理层对财务报表的责任.....	16
6.2 注册会计师的责任.....	16
6.3 审计意见.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	45
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
8.6 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.....	58

8.7	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 .....	59
8.8	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 .....	59
8.9	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 .....	59
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
8.12	投资组合报告附注 .....	59
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>60</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	61
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4	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 .....	61
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>61</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>62</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2	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 .....	62
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4	基金投资策略的改变 .....	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8	其他重大事件 .....	64
<b>§12</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>69</b>
12.1	备查文件目录 .....	69
12.2	存放地点 .....	69
12.3	查阅方式 .....	69

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)
基金简称	国联安双力中小板(LOF)
场内简称	国安双力
基金主代码	162510
交易代码	162510
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015 年 3 月 24 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	29,993,045.51 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 5 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	陆康芸	田青
	联系电话	021-38992806	010-67595096
	电子邮箱	customer.service@gtja-allianz.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	010-67595096
传真		021-50151582	010-66275853
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		虞启斌	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报及深交所网站
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gtja-allianz.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2016 年	2015 年 3 月 24 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
---------------	--------	--

本期已实现收益	2,669,292.98	8,046,027.93
本期利润	-922,962.66	932,912.20
加权平均基金份额本期利润	-0.0163	0.0620
本期加权平均净值利润率	-1.24%	3.12%
本期基金份额净值增长率	-12.63%	18.17%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>
期末可供分配利润	3,316,318.53	11,345,161.83
期末可供分配基金份额利润	0.1106	0.9438
期末基金资产净值	31,591,425.36	24,541,187.92
期末基金份额净值	1.053	2.042
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2016 年末</b>	<b>2015 年末</b>
基金份额累计净值增长率	3.25%	18.17%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字；

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.23%	0.77%	-0.98%	0.82%	-1.25%	-0.05%
过去六个月	1.45%	0.91%	-0.71%	0.89%	2.16%	0.02%
过去一年	-12.63%	1.72%	-14.00%	1.80%	1.37%	-0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金份额转换日次日起至	3.25%	2.32%	7.08%	2.27%	-3.83%	0.05%

今						
---	--	--	--	--	--	--

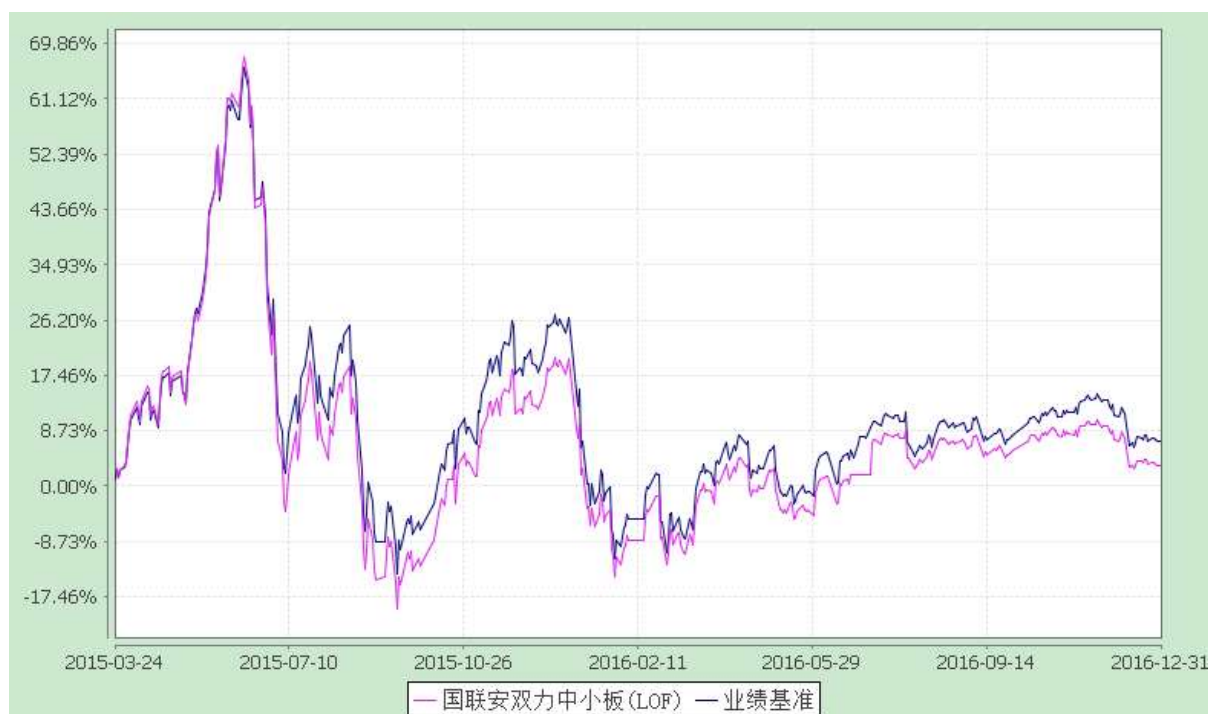
注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

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

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2015 年 3 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；



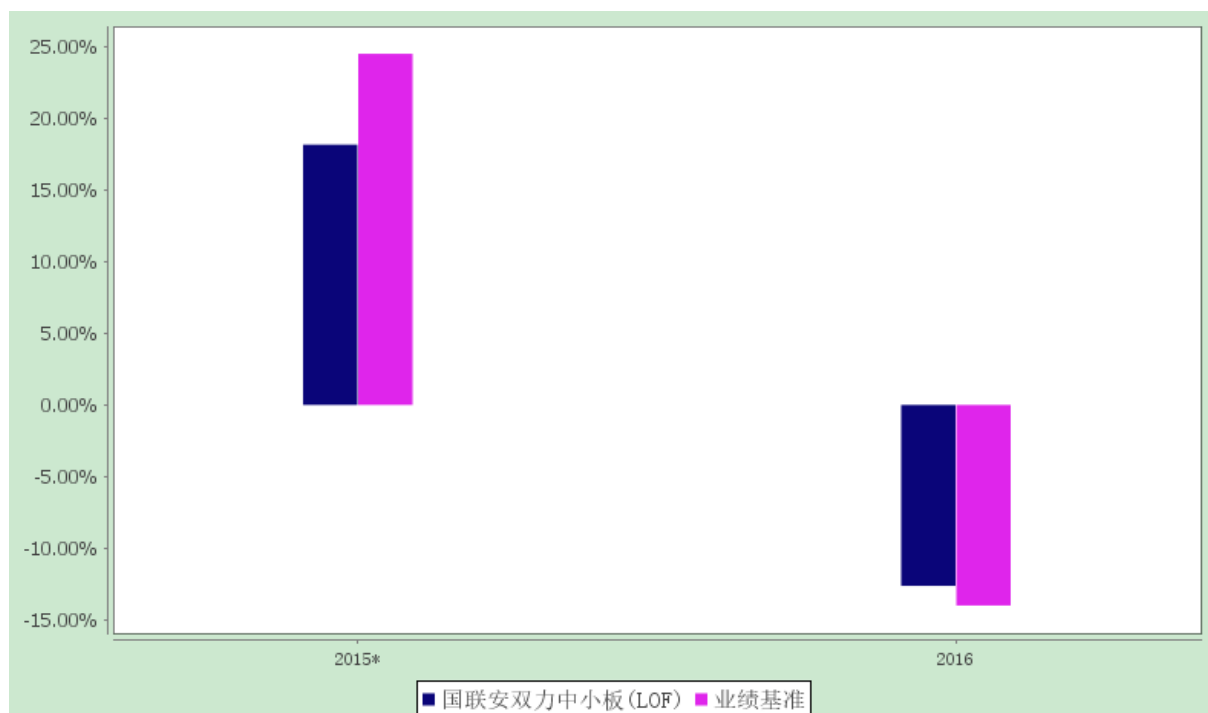
3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”；

2、\*基金转型当年按实际存续期计算的净值增长率；

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

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	7.200	1,167,625,941.14	1,482,938.07	1,169,108,879.21	-
合计	7.200	1,167,625,941.14	1,482,938.07	1,169,108,879.21	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为国泰君安证券股份有限公司，是目前中国规模最大、经营范围最宽、机构分布最广的综合类证券公司之一；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。截至本报告期末，公司共管理三十七只开放式基金。国联安基金管理公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冒浩	本基金基金经理、兼任国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理	2015-05-29	2016-09-27	6年（自2010年起）	冒浩，英国帝国理工大学硕士研究生毕业，2009年加入国联安基金管理有限公司，从事量化投资相关工作。先后担任基金经理助理、基金经理。2015年5月至2016年9月担任国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理。2015年5月至2016年9月兼任国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金经理。
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股	2016-08-19	-	14年（自2002年起）	黄欣先生，伦敦经济学院会计金融专业硕士。2003年10月起加入国联安基金管理有限公司，先后担任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安

	票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理、国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理			心混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 4 月起担任国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金经理，2010 年 5 月至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理，2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理，2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2013 年 6 月起兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理，2016 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设

置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部定期对成交的银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

#### 4.3.2 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公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先、价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 1 次，成交较少的投资组合是指数基金，该基金根据指数公司公布的指数成份股以及权重进行被动化投资。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，执行了 95%置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验，同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析，未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年, 股市在 1 月份的大幅下挫之后缓慢反弹, 大小盘股表现分化明显, 大盘蓝筹股表现较好。全年沪深 300 指数下跌约 11.28%, 中小板综指下跌 14.89%。分板块来看, 化工、建筑等板块表现较好, 机械、医药等行业表现较差。依据基金合同的约定, 双力基金始终保持合理的仓位, 采用抽样复制的方法跟踪中小板综指, 将跟踪误差控制在合理范围。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末, 本基金份额净值为 1.053 元, 本报告期份额净值增长率为-12.63%, 同期业绩比较基准收益率为-14.00%。本报告期内, 日均跟踪偏离度为 0.15%, 符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%的限制; 年化跟踪误差为 5.91%, 超过基金合同约定的年化跟踪误差不超过 4.0%的限制, 主要系部分成份股长期停牌导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整, 同时遭遇大额申购赎回造成净值波动所致。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年全球经济形势严峻复杂, 欧洲难民涌入、英国脱欧、美国大选等事件都给萎靡不振的经济带来一定的冲击。国内方面, 宏观经济增速放缓的趋势有所缓解。投资、净出口对经济增长的贡献率均有所下滑, PMI 指数略有回升, 但实体经济复苏的征兆尚未显现。2017 年, 经济依旧面临下行压力, 预计控制风险、稳中求进依然是政策监管的主基调, 货币政策预计中性偏紧。本基金期待政府能够继续推动经济转型、改善经济结构、刺激经济发展。于此同时, 盈利增长稳定、估值相对合理的股票可能会是 2017 年稳健的投资选择。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内, 基金管理人在内部监察工作中本着一切合法合规运作的指导思想、以保障基金份额持有人利益为宗旨, 由独立于各业务部门的内部监察人员对公司的经营管理、基金的投资运作及员工的行为规范等方面进行定期和不定期检查, 发现问题及时督促有关部门进行整改, 并定期制作监察报告报公司管理层。具体来说, 报告期内基金管理人的内部监察工作重点集中于以下几个方面:

(1) 随着相关法律法规的相继公布和实施, 监管机构对基金行业的管理也日趋细化和深化。公司对合规经营和风险防范十分重视, 为此, 公司密切关注监管部门所颁布的各项最新的法律法规, 紧跟监管机构的步伐, 组织相应部门学习并贯彻落实相应法规。除及时对新进员工进行合规培训外, 还在新的法律法规出台时安排了相关法律培训, 使员工加深对法律法规及公司规范的理解, 力求加

强员工的合规意识。

(2) 报告期内，中国证监会要求证券基金期货经营机构树立主动风控、全员风控的理念，着力健全风险管理体系，强化风险管控。上海证监局在辖区机构监管工作会议上明确提出，要反思股市异常波动的深刻教训，揭示行业和辖区存在的风险和隐患，传导“强监管，防风险”的监管理念。中国证监会进一步明确了依法从严全面监管的政策导向，要求基金行业回归资产管理业务本源。公司在监管机构的指导下，进一步推动合规经营和风险防范，多次通过邮件和培训等多种形式对投研人员加强教育、引导和监督，并加大了各项稽核力度。

(3) 通过组织各部门认真贯彻落实法规政策、定期自查、监察部门的定期/不定期的抽查，对公司业务的各个方面进行监督检查，包括基金投资、运作、销售以及信息披露等领域，以实现公司的合法合规经营，维护基金份额持有人、公司股东和公司的合法权益。

(4) 加强与托管行相关监督部门的日常联系。监察部门分别与托管银行的基金日常监督部门加强联系，确定了日常监督的工作方式、业务合作等，并完善日常监督方面的沟通与联系。

基金管理人将继续致力于维护一个有效率、效果的内部控制体系，以风险防范为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司基金事务部、投资组合管理部、交易部、监察稽核部、风险管理部、数量策略部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，数量策略部、研究部、投资组合管理部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定，以及本基金实际运作情况，本基金对本报告期内利润分配情况如下，符合本基金基金合同的相关规定。

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

1,169,108,879.21 元。

#### 4.9 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

2016年1月4日-2016年6月22日、2016年7月5日-2016年12月31日本基金资产净值低于5000万元。

基金管理人拟加大营销力度，提升基金规模。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为1,169,108,879.21元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### §6 审计报告

毕马威华振审字第1700477号

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)(以下简称“国联安双力基金(LOF)”)财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

## 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是国联安双力基金 (LOF) 管理人国联安基金管理有限公司管理层的责任, 这种责任包括: (1) 按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

## 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价国联安基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 审计意见

我们认为, 国联安双力基金 (LOF) 财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了国联安双力基金 (LOF) 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果及基金净值变动情况。

毕马威华振会计师事务所 中国注册会计师

王国蓓 张楠

上海市南京西路 1266 号恒隆广场 49-51 楼

2017 年 3 月 24 日



## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	4,064,273.96	3,188,795.19
结算备付金		-	17,731.87
存出保证金		2,418.85	12,473.07
交易性金融资产	7.4.7.2	27,131,623.87	21,511,754.38
其中：股票投资		27,131,623.87	21,511,754.38
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	920.23	631.05
应收股利		-	-
应收申购款		1,994,631.08	1,587.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>33,193,867.99</b>	<b>24,732,972.84</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,432,740.59	89.03
应付赎回款		44,907.59	65,279.46
应付管理人报酬		14,132.34	15,728.37
应付托管费		4,145.47	4,613.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,289.77	9,604.57
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	96,226.87	96,469.83
<b>负债合计</b>		<b>1,602,442.63</b>	<b>191,784.92</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	28,275,106.83	11,245,301.70
未分配利润	7.4.7.10	3,316,318.53	13,295,886.22
<b>所有者权益合计</b>		<b>31,591,425.36</b>	<b>24,541,187.92</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>33,193,867.99</b>	<b>24,732,972.84</b>

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.053 元，基金份额总额 29,993,045.51 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至	2015 年 3 月 24 日（基

		2016年12月31日	金合同生效日)至2015 年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>259,035.41</b>	<b>1,510,117.97</b>
1.利息收入		520,692.21	19,119.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	520,692.21	19,119.48
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,222,136.70	8,537,147.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,074,065.21	8,385,892.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	148,071.49	151,255.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-3,592,255.64	-7,113,115.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,108,462.14	66,966.32
<b>减：二、费用</b>		<b>1,181,998.07</b>	<b>577,205.77</b>
1. 管理人报酬		587,547.47	173,067.78
2. 托管费		172,347.22	50,766.55
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	65,311.79	80,748.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	356,791.59	272,623.38

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-922,962.66	932,912.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-922,962.66	932,912.20

注：本基金于 2015 年 3 月 24 日转型。上年度可比期间为 2015 年 3 月 24 日（基金转型后首日）至 2015 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,245,301.70	13,295,886.22	24,541,187.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-922,962.66	-922,962.66
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）	17,029,805.13	1,160,052,274.18	1,177,082,079.31
其中：1.基金申购款	1,534,938,108.54	1,329,243,917.66	2,864,182,026.20
2.基金赎回款	-1,517,908,303.41	-169,191,643.48	-1,687,099,946.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,169,108,879.21	-1,169,108,879.21
五、期末所有者权益（基	28,275,106.83	3,316,318.53	31,591,425.36

项目	上年度可比期间		
	2015年3月24日(基金合同生效日)至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	17,150,609.79	14,520,270.99	31,670,880.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	932,912.20	932,912.20
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)	-5,905,308.09	-2,157,296.97	-8,062,605.06
其中：1.基金申购款	18,568,203.28	28,602,482.23	47,170,685.51
2.基金赎回款	-24,473,511.37	-30,759,779.20	-55,233,290.57
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)	11,245,301.70	13,295,886.22	24,541,187.92

注：本基金于2015年3月24日转型。上年度可比期间为2015年3月24日(基金转型后首日)至2015年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:谭晓雨,主管会计工作负责人:李柯,会计机构负责人:仲晓峰

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)由国联安双力中小板综指分

级证券投资基金转型而成。国联安双力中小板综指分级证券投资基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]1593号文)批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2012年3月23日生效。根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》及《国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》,国联安双力中小板综指分级证券投资基金于2015年3月23日三年分级运作期届满,自2015年3月24日起转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。于基金分级运作期届满日2015年3月23日日终,国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金份额。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,转型后首日基金规模为18,332,807.68份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》和《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%,其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%,投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券;权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。本基金业绩比较基准为:95%×中小板综指收益率+5%×活期存款利率(税后)。

经深圳证券交易所深证上[2015]207号文件审核同意,本基金11,000,077.00份基金份额于2015年5月20日在深圳证券交易所上市交易。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金目前持有的股票投资和债券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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,相关交易费用直接计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后,金融资产和金融负债的后续计量如下:

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量,公允价值变动

形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征(包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等)，并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

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。

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。

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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，



以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损

益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金分级运作期满并转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)后，每一基金份额享有同等分配权。场外份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式。基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。场内份额收益分配只采用现金红利一种方式，基金份额持有人不能自行选择。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。基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%。基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过 15 个工作日。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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》，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 of 的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所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。

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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

##### **(1)主要税项说明**

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，

本基金适用的主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下简称“营改增”）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资产管理产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资产管理产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资产管理产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f)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。

(g)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2016年12月31日	2015年12月31日
活期存款	4,064,273.96	3,188,795.19
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	4,064,273.96	3,188,795.19

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		24,371,339.31	27,131,623.87	2,760,284.56
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		24,371,339.31	27,131,623.87	2,760,284.56
项目		上年度末		
		2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		15,159,214.18	21,511,754.38	6,352,540.20
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	15,159,214.18	21,511,754.38	6,352,540.20

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	919.02	616.08
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	-	8.80
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1.21	6.16
合计	920.23	631.05

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息。

**7.4.7.6 其他资产**

本基金于本报告期末及上年度末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	10,289.77	9,604.57
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	10,289.77	9,604.57

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	169.24	246.02
预提信息披露费	30,000.00	30,000.00
指数使用费	1,057.63	1,223.81
预提审计费	65,000.00	65,000.00
合计	96,226.87	96,469.83

**7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,020,101.89	11,245,301.70
本期申购	1,640,620,227.74	1,534,938,108.54
本期赎回（以“-”号填列）	-1,622,647,284.12	-1,517,908,303.41
本期末	29,993,045.51	28,275,106.83

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,345,161.83	1,950,724.39	13,295,886.22
本期利润	2,669,292.98	-3,592,255.64	-922,962.66
本期基金份额交易产生的变动数	1,164,253,422.80	-4,201,148.62	1,160,052,274.18
其中：基金申购款	1,547,279,044.01	-218,035,126.35	1,329,243,917.66
基金赎回款	-383,025,621.21	213,833,977.73	-169,191,643.48
本期已分配利润	-1,169,108,879.21	-	-1,169,108,879.21
本期末	9,158,998.40	-5,842,679.87	3,316,318.53

7.4.7.11 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12月 31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
活期存款利息收入	406,679.15	18,725.64
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	248.94	275.46
其他	113,764.12	118.38
合计	520,692.21	19,119.48

注：此处其他列示的是基金申购款滞留利息及结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同 生效日）至2015年12月31



		日
卖出股票成交总额	19,057,653.73	30,032,078.48
减：卖出股票成本总额	17,983,588.52	21,646,185.94
买卖股票差价收入	1,074,065.21	8,385,892.54

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益赎回差价收入。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	148,071.49	151,255.36
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	148,071.49	151,255.36

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效 日）至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-3,592,255.64	-7,113,115.73

——股票投资	-3,592,255.64	-7,113,115.73
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-3,592,255.64	-7,113,115.73

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
基金赎回费收入	2,108,421.30	66,847.19
转换费收入	40.84	119.13
合计	2,108,462.14	66,966.32

注：本基金赎回费和转换费的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效日）至 2015年12月31日
交易所市场交易费用	65,311.79	80,748.06
银行间市场交易费用	-	-
合计	65,311.79	80,748.06

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效日） 至2015年12月31日
审计费用	65,000.00	52,644.24
信息披露费	30,000.00	23,260.42
银行划款费用	1,907.77	2,289.62
上市费	60,000.00	40,000.00
其他	50.00	-
指数使用费	199,833.82	154,429.10
合计	356,791.59	272,623.38

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司（“国泰君安”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司（“中德安联”）	基金管理人的股东控制的公司

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金与关联方无债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	587,547.47	173,067.78
其中：支付销售机构的客户维护费	74,689.03	40,311.95

注：在本基金分级运作期到期后，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同 生效日）至2015年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,347.22	50,766.55

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

本报告期内及上年度可比期间，其他关联方均未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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12月31日		上年度可比期间 2015年3月24日（基金合同生效日） 至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,064,273.96	406,679.15	3,188,795.19	18,725.64

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。本基金通过“建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2016年12月31日的相关余额为零元。(2015年：人民币17,731.87元)

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2016-06-28	2016-06-29	2016-06-28	7.200	1,167,625.94 1.14	1,482,938.07	1,169,108.87 9.21	-
合计				7.200	1,167,625.94 1.14	1,482,938.07	1,169,108.87 9.21	-

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002685	华东重机	2016-12-19	重大事项	9.99	-	-	5,128.00	46,998.06	51,228.72	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	25.20	-	-	1,388.00	14,141.88	34,977.60	-
002071	长城影视	2016-06-16	重大事项	13.64	2017-01-03	15.00	1,951.00	13,482.67	26,611.64	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大事项	16.12	-	-	7,280.00	176,280.00	117,353.60	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	7,948.00	105,695.21	65,729.96	-
002151	北斗星通	2016-11-16	重大事项	31.90	2017-01-12	31.00	850.00	20,626.66	27,115.00	-
002156	通富微电	2016-12-28	重大事项	11.38	2017-01-05	11.65	3,908.00	25,897.73	44,473.04	-

002165	红宝丽	2016-10-10	重大事项	8.57	2017-01-05	9.43	2,566.00	17,192.20	21,990.62	-
002211	宏达新材	2016-12-28	重大事项	13.15	2017-01-23	12.40	2,599.00	24,918.56	34,176.85	-
002226	江南化工	2016-11-14	重大事项	8.61	2017-03-01	9.20	4,092.00	26,580.98	35,232.12	-
002316	键桥通讯	2016-11-10	重大事项	13.65	-	-	2,276.00	16,539.48	31,067.40	-
002335	科华恒盛	2016-12-16	重大事项	42.90	-	-	808.00	7,494.97	34,663.20	-
002377	国创高新	2016-07-18	重大事项	9.18	2017-01-19	9.25	2,966.00	10,160.85	27,227.88	-
002396	星网锐捷	2016-09-12	重大事项	19.70	2017-02-21	18.35	1,713.00	18,088.42	33,746.10	-
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79	-	-	2,923.00	33,598.73	40,308.17	-
002440	闰土股份	2016-10-24	重大事项	16.34	2017-01-12	15.22	1,693.00	14,080.60	27,663.62	-
002462	嘉事堂	2016-09-28	重大事项	42.53	2017-01-12	38.98	923.00	8,401.84	39,255.19	-
002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项	15.54	2017-01-03	15.89	3,548.00	101,269.47	55,135.92	-
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大事项	12.66	-	-	3,168.00	42,962.60	40,106.88	-
002567	唐人神	2016-12-22	重大事项	12.64	2017-01-03	12.75	2,977.00	24,755.43	37,629.28	-
002578	闽发铝业	2016-10-12	重大事项	11.89	-	-	2,397.00	13,801.51	28,500.33	-
002584	西陇科学	2016-09-12	重大事项	15.88	2017-03-02	14.29	1,885.00	7,315.36	29,933.80	-
002602	世纪华通	2016-12-15	重大事项	46.89	2017-01-09	50.00	1,722.00	7,084.68	80,744.58	-
002617	露笑科技	2016-12-23	重大事项	14.63	2017-01-23	15.60	3,681.00	24,002.64	53,853.03	-
002629	仁智股份	2016-10-10	重大事项	13.11	2017-02-17	12.31	2,019.00	9,333.09	26,469.09	-
002635	安洁科技	2016-11-08	重大事项	36.40	2017-02-08	33.50	1,000.00	16,890.00	36,400.00	-
002681	奋达科技	2016-12-19	重大事项	12.93	-	-	2,124.00	32,722.67	27,463.32	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元,因此没有作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2016 年 12 月 31 日)止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元,因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括:

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次:第一层次为董事会及督察长;第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部;第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具,识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险,向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告,确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。



本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有短期信用债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金均未持有长期信用债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易，因此除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	-------	-------	--------	------	------	-----	----

2016年12月 31日							
资产							
银行存款	4,064,273.96	-	-	-	-	-	4,064,273.96
结算备付金	0.00	-	-	-	-	-	0.00
存出保证金	2,418.85	-	-	-	-	-	2,418.85
交易性金融资产	-	-	-	-	-	27,131,623.87	27,131,623.87
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收利息	-	-	-	-	-	920.23	920.23
应收股利	-	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	118.86	-	-	-	-	1,994,512.22	1,994,631.08
其他资产	-	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	4,066,811.67	0.00	0.00	0.00	0.00	29,127,056.32	33,193,867.99
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,432,740.59	1,432,740.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	44,907.59	44,907.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	14,132.34	14,132.34
应付托管费	-	-	-	-	-	4,145.47	4,145.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	10,289.77	10,289.77
应交税费	-	-	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	-	96,226.87	96,226.87
负债总计	-	-	-	-	-	1,602,442.63	1,602,442.63
利率敏感度缺口	4,066,811.67	0.00	0.00	0.00	0.00	27,524,613.69	31,591,425.36

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	3,188,795.19	-	-	-	-	-	3,188,795.19
结算备付金	17,731.87	-	-	-	-	-	17,731.87
结算保证金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	12,473.07	-	-	-	-	-	12,473.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	21,511,754.38	21,511,754.38
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	631.05	631.05
应收申购款	-	-	-	-	-	1,587.28	1,587.28
资产总计	3,219,000.13	-	-	-	-	21,513,972.71	24,732,972.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	65,279.46	65,279.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	15,728.37	15,728.37
应付托管费	-	-	-	-	-	4,613.66	4,613.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,604.57	9,604.57
其他负债	-	-	-	-	-	96,469.83	96,469.83
应付证券清算款	-	-	-	-	-	89.03	89.03
负债总计	-	-	-	-	-	191,784.92	191,784.92
利率敏感度缺口	3,219,000.13	-	-	-	-	21,322,187.79	24,541,187.92

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有债券投资，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 85.88%，无债券投资和衍生金融资产。于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	27,131,623.87	85.88	21,511,754.38	87.66
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	27,131,623.87	85.88	21,511,754.38	87.66

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2016年12月31日	2015年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加 1,472,998.61	增加 1,298,439.10
	业绩比较基准下降 5%	减少 1,472,998.61	减少 1,298,439.10

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	27,131,623.87	81.74
	其中：股票	27,131,623.87	81.74
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,064,273.96	12.24
7	其他各项资产	1,997,970.16	6.02
8	合计	33,193,867.99	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	---------

			比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	316,730.33	1.00
B	采矿业	179,667.76	0.57
C	制造业	21,086,983.10	66.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	141,662.82	0.45
E	建筑业	896,038.37	2.84
F	批发和零售业	928,841.35	2.94
G	交通运输、仓储和邮政业	149,283.63	0.47
H	住宿和餐饮业	113,564.00	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,455,528.29	4.61
J	金融业	542,790.49	1.72
K	房地产业	525,470.00	1.66
L	租赁和商务服务业	445,234.39	1.41
M	科学研究和技术服务业	74,969.86	0.24
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	274,859.48	0.87
S	综合	-	-
	合计	27,131,623.87	85.88

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 8.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票投资。

## 8.3 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	002415	海康威视	22,678	539,963.18	1.71
2	002370	亚太药业	16,300	477,590.00	1.51
3	002252	上海莱士	18,600	429,474.00	1.36
4	002304	洋河股份	5,962	420,917.20	1.33
5	002465	海格通信	34,674	403,952.10	1.28
6	002511	中顺洁柔	19,451	387,074.90	1.23
7	002049	紫光国芯	10,300	339,282.00	1.07
8	002223	鱼跃医疗	10,700	331,914.00	1.05
9	002024	苏宁云商	23,900	273,655.00	0.87
10	002142	宁波银行	15,596	259,517.44	0.82
11	002450	康得新	13,419	256,437.09	0.81
12	002475	立讯精密	8,613	178,719.75	0.57
13	002594	比亚迪	3,554	176,562.72	0.56
14	002241	歌尔股份	6,636	175,986.72	0.56
15	002493	荣盛石化	10,082	155,464.44	0.49
16	002085	万丰奥威	7,810	154,325.60	0.49
17	002500	山西证券	12,050	144,841.00	0.46
18	002695	煌上煌	5,112	144,720.72	0.46
19	002694	顾地科技	3,400	143,310.00	0.45
20	002065	东华软件	6,000	139,800.00	0.44
21	002673	西部证券	6,665	138,432.05	0.44
22	002007	华兰生物	3,549	126,876.75	0.40
23	002018	华信国际	12,472	126,840.24	0.40
24	002219	恒康医疗	9,912	118,745.76	0.38
25	002075	沙钢股份	7,280	117,353.60	0.37
26	002456	欧菲光	3,408	116,826.24	0.37
27	002537	海立美达	3,552	115,013.76	0.36
28	002236	大华股份	8,372	114,528.96	0.36
29	002146	荣盛发展	14,483	113,691.55	0.36
30	002186	全聚德	5,162	113,564.00	0.36
31	002508	老板电器	3,050	112,240.00	0.36
32	002202	金风科技	6,521	111,574.31	0.35
33	002311	海大集团	7,281	109,579.05	0.35
34	002739	万达院线	2,000	108,140.00	0.34
35	002183	怡亚通	9,900	107,514.00	0.34
36	002081	金螳螂	10,776	105,497.04	0.33
37	002179	中航光电	2,891	104,914.39	0.33
38	002470	金正大	13,048	103,079.20	0.33

39	002051	中工国际	4,492	102,956.64	0.33
40	002008	大族激光	4,518	102,106.80	0.32
41	002389	南洋科技	4,200	96,936.00	0.31
42	002187	广百股份	6,855	96,792.60	0.31
43	002399	海普瑞	5,241	95,491.02	0.30
44	002544	杰赛科技	3,326	93,593.64	0.30
45	002563	森马服饰	8,986	92,286.22	0.29
46	002461	珠江啤酒	7,648	92,158.40	0.29
47	002343	慈文传媒	2,000	90,340.00	0.29
48	002299	圣农发展	4,070	86,365.40	0.27
49	002597	金禾实业	5,522	86,308.86	0.27
50	002650	加加食品	12,141	85,472.64	0.27
51	002618	丹邦科技	3,382	85,395.50	0.27
52	002310	东方园林	5,960	84,334.00	0.27
53	002557	洽洽食品	5,236	84,090.16	0.27
54	002122	天马股份	6,599	83,741.31	0.27
55	002287	奇正藏药	1,851	81,980.79	0.26
56	002444	巨星科技	5,206	81,213.60	0.26
57	002602	世纪华通	1,722	80,744.58	0.26
58	002050	三花智控	7,274	80,304.96	0.25
59	002589	瑞康医药	2,424	78,658.80	0.25
60	002281	光迅科技	1,000	78,500.00	0.25
61	002333	罗普斯金	5,384	78,498.72	0.25
62	002152	广电运通	5,898	78,325.44	0.25
63	002408	齐翔腾达	7,016	77,176.00	0.24
64	002038	双鹭药业	2,856	76,283.76	0.24
65	002012	凯恩股份	5,988	75,927.84	0.24
66	002572	索菲亚	1,400	75,824.00	0.24
67	002127	南极电商	6,600	75,768.00	0.24
68	002032	苏泊尔	2,155	75,252.60	0.24
69	002035	华帝股份	2,879	74,710.05	0.24
70	002031	巨轮智能	21,834	74,453.94	0.24
71	002437	誉衡药业	9,000	74,430.00	0.24
72	002376	新北洋	5,992	74,300.80	0.24
73	002689	远大智能	10,405	73,771.45	0.23
74	002385	大北农	10,316	73,243.60	0.23
75	002030	达安基因	3,107	72,082.40	0.23
76	002676	顺威股份	2,632	70,774.48	0.22
77	002292	奥飞娱乐	3,112	70,642.40	0.22
78	002427	尤夫股份	3,400	70,414.00	0.22
79	002294	信立泰	2,398	70,117.52	0.22
80	002313	日海通讯	3,000	69,900.00	0.22
81	002640	跨境通	3,800	69,540.00	0.22
82	002647	宏磊股份	1,032	69,412.32	0.22



83	002256	兆新股份	10,748	69,002.16	0.22
84	002353	杰瑞股份	3,385	68,715.50	0.22
85	002520	日发精机	5,734	67,947.90	0.22
86	002301	齐心集团	3,122	67,747.40	0.21
87	002244	滨江集团	9,656	67,398.88	0.21
88	002384	东山精密	3,433	67,321.13	0.21
89	002429	兆驰股份	6,702	66,751.92	0.21
90	002665	首航节能	7,608	66,646.08	0.21
91	002603	以岭药业	3,865	66,632.60	0.21
92	002078	太阳纸业	9,881	66,005.08	0.21
93	002129	中环股份	7,948	65,729.96	0.21
94	002498	汉缆股份	15,240	65,532.00	0.21
95	002489	浙江永强	8,651	65,488.07	0.21
96	002168	深圳惠程	4,109	65,168.74	0.21
97	002271	东方雨虹	2,998	65,026.62	0.21
98	002138	顺络电子	3,750	64,912.50	0.21
99	002628	成都路桥	6,868	64,902.60	0.21
100	002340	格林美	9,900	64,845.00	0.21
101	002108	沧州明珠	3,171	64,593.27	0.20
102	002426	胜利精密	7,800	64,506.00	0.20
103	002143	印纪传媒	2,000	64,420.00	0.20
104	002041	登海种业	3,405	64,286.40	0.20
105	002097	山河智能	7,176	64,225.20	0.20
106	002407	多氟多	2,350	64,131.50	0.20
107	002285	世联行	8,411	63,923.60	0.20
108	002556	辉隆股份	6,113	63,514.07	0.20
109	002147	新光圆成	3,599	63,414.38	0.20
110	002210	飞马国际	3,430	63,283.50	0.20
111	002092	中泰化学	5,213	63,077.30	0.20
112	002080	中材科技	3,574	62,616.48	0.20
113	002155	湖南黄金	5,453	62,436.85	0.20
114	002501	利源精制	5,074	62,257.98	0.20
115	002601	佰利联	4,883	61,818.78	0.20
116	002367	康力电梯	4,642	61,320.82	0.19
117	002303	美盈森	5,952	61,186.56	0.19
118	002620	瑞和股份	1,116	61,022.88	0.19
119	002474	榕基软件	4,485	60,816.60	0.19
120	002630	华西能源	4,894	60,343.02	0.19
121	002062	宏润建设	8,953	59,985.10	0.19
122	002435	长江润发	2,869	59,876.03	0.19
123	002216	三全食品	4,842	59,072.40	0.19
124	002506	协鑫集成	10,700	59,064.00	0.19
125	002089	新海宜	4,161	59,044.59	0.19
126	002570	贝因美	4,500	59,040.00	0.19

127	002574	明牌珠宝	5,096	58,960.72	0.19
128	002405	四维图新	3,037	58,765.95	0.19
129	002242	九阳股份	3,200	57,696.00	0.18
130	002416	爱施德	3,900	57,447.00	0.18
131	002077	大港股份	3,210	57,394.80	0.18
132	002701	奥瑞金	6,641	57,378.24	0.18
133	002128	露天煤业	6,653	57,215.80	0.18
134	002481	双塔食品	6,300	57,141.00	0.18
135	002359	齐星铁塔	2,000	57,140.00	0.18
136	002410	广联达	3,900	56,940.00	0.18
137	002276	万马股份	3,781	56,828.43	0.18
138	002331	皖通科技	3,188	56,746.40	0.18
139	002268	卫士通	1,800	56,556.00	0.18
140	002053	云南能投	2,946	56,533.74	0.18
141	002190	成飞集成	1,761	56,316.78	0.18
142	002503	搜于特	3,913	56,308.07	0.18
143	002153	石基信息	2,295	55,929.15	0.18
144	002641	永高股份	6,637	55,817.17	0.18
145	002201	九鼎新材	2,600	55,640.00	0.18
146	002646	青青稞酒	2,887	55,574.75	0.18
147	002250	联化科技	3,427	55,448.86	0.18
148	002485	希努尔	2,625	55,387.50	0.18
149	002491	通鼎互联	3,548	55,135.92	0.17
150	002001	新和成	2,809	55,056.40	0.17
151	002476	宝莫股份	5,259	55,009.14	0.17
152	002221	东华能源	4,436	54,962.04	0.17
153	002484	江海股份	3,345	54,958.35	0.17
154	002424	贵州百灵	2,900	54,926.00	0.17
155	002510	天汽模	7,900	54,905.00	0.17
156	002177	御银股份	7,151	54,776.66	0.17
157	002436	兴森科技	7,964	54,553.40	0.17
158	002609	捷顺科技	3,400	54,400.00	0.17
159	002564	天沃科技	5,418	54,180.00	0.17
160	002191	劲嘉股份	5,184	53,965.44	0.17
161	002422	科伦药业	3,346	53,937.52	0.17
162	002617	露笑科技	3,681	53,853.03	0.17
163	002004	华邦健康	5,923	53,721.61	0.17
164	002627	宜昌交运	2,163	53,512.62	0.17
165	002366	台海核电	996	53,405.52	0.17
166	002237	恒邦股份	4,635	53,302.50	0.17
167	002518	科士达	2,478	53,004.42	0.17
168	002483	润邦股份	4,487	52,901.73	0.17
169	002482	广田集团	5,715	52,863.75	0.17
170	002528	英飞拓	7,178	52,830.08	0.17

171	002661	克明面业	3,200	52,736.00	0.17
172	002432	九安医疗	3,391	52,662.23	0.17
173	002372	伟星新材	3,408	52,585.44	0.17
174	002649	博彦科技	1,350	52,515.00	0.17
175	002308	威创股份	3,556	52,415.44	0.17
176	002414	高德红外	2,300	52,394.00	0.17
177	002107	沃华医药	3,169	52,320.19	0.17
178	002099	海翔药业	6,168	52,304.64	0.17
179	002269	美邦服饰	10,439	52,299.39	0.17
180	002047	宝鹰股份	5,592	52,285.20	0.17
181	002439	启明星辰	2,484	51,642.36	0.16
182	002394	联发股份	2,908	51,413.44	0.16
183	002468	申通快递	1,700	51,374.00	0.16
184	002685	华东重机	5,128	51,228.72	0.16
185	002131	利欧股份	3,200	51,040.00	0.16
186	002170	芭田股份	5,489	50,992.81	0.16
187	002086	东方海洋	4,448	50,974.08	0.16
188	002314	南山控股	6,682	50,916.84	0.16
189	002344	海宁皮城	4,493	50,860.76	0.16
190	002643	万润股份	1,400	50,820.00	0.16
191	002232	启明信息	3,807	50,671.17	0.16
192	002154	报喜鸟	9,343	50,639.06	0.16
193	002638	勤上光电	5,497	50,572.40	0.16
194	002203	海亮股份	6,249	50,366.94	0.16
195	002206	海利得	2,622	50,185.08	0.16
196	002204	大连重工	11,294	50,145.36	0.16
197	002217	合力泰	2,800	50,120.00	0.16
198	002055	得润电子	2,100	49,791.00	0.16
199	002502	骅威文化	3,852	49,767.84	0.16
200	002531	天顺风能	7,231	49,749.28	0.16
201	002056	横店东磁	3,566	49,603.06	0.16
202	002662	京威股份	3,015	49,596.75	0.16
203	002195	二三四五	4,380	49,581.60	0.16
204	002185	华天科技	4,085	49,346.80	0.16
205	002093	国脉科技	4,453	49,294.71	0.16
206	002180	艾派克	1,750	49,210.00	0.16
207	002267	陕天然气	5,108	48,985.72	0.16
208	002277	友阿股份	3,393	48,723.48	0.15
209	002083	孚日股份	6,882	48,655.74	0.15
210	002433	太安堂	4,487	48,639.08	0.15
211	002540	亚太科技	6,130	48,120.50	0.15
212	002284	亚太股份	3,417	48,077.19	0.15
213	002273	水晶光电	2,412	47,998.80	0.15
214	002371	七星电子	1,800	47,880.00	0.15

215	002048	宁波华翔	2,159	47,800.26	0.15
216	002425	凯撒文化	2,100	47,775.00	0.15
217	002228	合兴包装	9,064	47,586.00	0.15
218	002110	三钢闽光	3,600	47,520.00	0.15
219	002064	华峰氨纶	8,610	47,268.90	0.15
220	002375	亚厦股份	4,453	47,112.74	0.15
221	002519	银河电子	2,100	47,040.00	0.15
222	002006	精功科技	4,198	47,017.60	0.15
223	002479	富春环保	3,155	46,757.10	0.15
224	002141	蓉胜超微	4,646	46,645.84	0.15
225	002079	苏州固锝	5,074	46,528.58	0.15
226	002596	海南瑞泽	1,544	46,289.12	0.15
227	002348	高乐股份	6,000	46,260.00	0.15
228	002251	步步高	2,805	46,142.25	0.15
229	002100	天康生物	5,136	46,069.92	0.15
230	002175	东方网络	3,020	46,055.00	0.15
231	002559	亚威股份	3,099	46,020.15	0.15
232	002039	黔源电力	2,800	45,920.00	0.15
233	002523	天桥起重	6,853	45,915.10	0.15
234	002117	东港股份	1,531	45,853.45	0.15
235	002096	南岭民爆	3,169	45,792.05	0.14
236	002068	黑猫股份	5,448	45,654.24	0.14
237	002262	恩华药业	2,171	45,373.90	0.14
238	002347	泰尔股份	3,396	45,268.68	0.14
239	002167	东方锆业	3,337	45,216.35	0.14
240	002477	雏鹰农牧	9,000	45,180.00	0.14
241	002449	国星光电	3,391	45,032.48	0.14
242	002013	中航机电	2,446	44,737.34	0.14
243	002624	完美世界	1,500	44,685.00	0.14
244	002171	楚江新材	2,809	44,522.65	0.14
245	002362	汉王科技	1,972	44,488.32	0.14
246	002565	顺灏股份	5,519	44,483.14	0.14
247	002156	通富微电	3,908	44,473.04	0.14
248	002678	珠江钢琴	2,982	44,372.16	0.14
249	002675	东诚药业	3,101	44,344.30	0.14
250	002656	摩登大道	2,040	44,288.40	0.14
251	002386	天原集团	4,897	44,219.91	0.14
252	002463	沪电股份	9,248	44,205.44	0.14
253	002595	豪迈科技	2,100	44,205.00	0.14
254	002302	西部建设	5,932	44,134.08	0.14
255	002332	仙琚制药	3,428	44,118.36	0.14
256	002060	粤水电	5,729	44,113.30	0.14
257	002010	传化智联	2,344	44,067.20	0.14
258	002074	国轩高科	1,407	43,602.93	0.14

259	002534	杭锅股份	3,905	43,579.80	0.14
260	002121	科陆电子	4,935	43,526.70	0.14
261	002355	兴民智通	3,200	43,488.00	0.14
262	002382	蓝帆医疗	3,572	43,471.24	0.14
263	002657	中科金财	1,000	43,160.00	0.14
264	002275	桂林三金	2,349	43,151.13	0.14
265	002181	粤传媒	5,467	43,079.96	0.14
266	002550	千红制药	5,932	42,829.04	0.14
267	002019	亿帆医药	2,800	42,812.00	0.14
268	002393	力生制药	1,031	42,580.30	0.13
269	002668	奥马电器	600	42,570.00	0.13
270	002208	合肥城建	2,645	42,558.05	0.13
271	002577	雷柏科技	1,400	42,476.00	0.13
272	002459	天业通联	2,400	42,456.00	0.13
273	002626	金达威	3,036	42,170.04	0.13
274	002402	和而泰	4,100	41,984.00	0.13
275	002209	达意隆	1,800	41,742.00	0.13
276	002014	永新股份	2,607	41,712.00	0.13
277	002220	天宝股份	3,092	41,711.08	0.13
278	002622	融钰集团	2,854	41,611.32	0.13
279	002345	潮宏基	3,434	41,482.72	0.13
280	002413	雷科防务	3,580	41,456.40	0.13
281	002115	三维通信	3,919	41,267.07	0.13
282	002625	龙生股份	1,100	41,206.00	0.13
283	002042	华孚色纺	3,590	41,141.40	0.13
284	002693	双成药业	3,800	40,964.00	0.13
285	002082	栋梁新材	2,100	40,887.00	0.13
286	002124	天邦股份	3,343	40,550.59	0.13
287	002674	兴业科技	2,281	40,510.56	0.13
288	002698	博实股份	2,600	40,482.00	0.13
289	002261	拓维信息	3,390	40,408.80	0.13
290	002431	棕榈股份	4,407	40,368.12	0.13
291	002020	京新药业	3,564	40,344.48	0.13
292	002283	天润曲轴	5,190	40,326.30	0.13
293	002400	省广股份	2,923	40,308.17	0.13
294	002266	浙富控股	6,969	40,141.44	0.13
295	002548	金新农	2,781	40,129.83	0.13
296	002492	恒基达鑫	3,168	40,106.88	0.13
297	002148	北纬通信	2,100	40,026.00	0.13
298	002106	莱宝高科	3,558	39,991.92	0.13
299	002392	北京利尔	6,918	39,847.68	0.13
300	002279	久其软件	2,320	39,788.00	0.13
301	002029	七匹狼	3,886	39,676.06	0.13
302	002022	科华生物	1,982	39,640.00	0.13

303	002104	恒宝股份	3,359	39,602.61	0.13
304	002663	普邦股份	6,500	39,455.00	0.12
305	002418	康盛股份	3,851	39,395.73	0.12
306	002443	金洲管道	3,600	39,384.00	0.12
307	002045	国光电器	3,162	39,366.90	0.12
308	002462	嘉事堂	923	39,255.19	0.12
309	002317	众生药业	3,178	39,248.30	0.12
310	002398	建研集团	2,867	38,933.86	0.12
311	002023	海特高新	2,810	38,890.40	0.12
312	002612	朗姿股份	2,142	38,813.04	0.12
313	002488	金固股份	2,325	38,595.00	0.12
314	002240	威华股份	3,329	38,516.53	0.12
315	002588	史丹利	3,380	38,363.00	0.12
316	002003	伟星股份	2,677	38,361.41	0.12
317	002451	摩恩电气	2,415	38,350.20	0.12
318	002091	江苏国泰	2,883	38,228.58	0.12
319	002472	双环传动	3,358	38,079.72	0.12
320	002318	久立特材	3,800	38,000.00	0.12
321	002087	新野纺织	5,382	37,674.00	0.12
322	002567	唐人神	2,977	37,629.28	0.12
323	002546	新联电子	4,137	37,522.59	0.12
324	002364	中恒电气	1,800	37,440.00	0.12
325	002339	积成电子	1,965	37,413.60	0.12
326	002118	紫鑫药业	5,154	37,108.80	0.12
327	002174	游族网络	1,400	37,030.00	0.12
328	002533	金杯电工	3,569	36,689.32	0.12
329	002328	新朋股份	3,411	36,600.03	0.12
330	002321	华英农业	3,405	36,467.55	0.12
331	002369	卓翼科技	3,567	36,454.74	0.12
332	002635	安洁科技	1,000	36,400.00	0.12
333	002356	赫美集团	1,502	36,348.40	0.12
334	002420	毅昌股份	3,600	36,324.00	0.11
335	002590	万安科技	1,786	36,291.52	0.11
336	002455	百川股份	2,840	36,266.80	0.11
337	002430	杭氧股份	4,184	36,191.60	0.11
338	002178	延华智能	3,900	36,036.00	0.11
339	002543	万和电气	2,068	35,983.20	0.11
340	002428	云南锗业	2,834	35,906.78	0.11
341	002305	南国置业	6,912	35,873.28	0.11
342	002224	三力士	2,385	35,870.40	0.11
343	002521	齐峰新材	3,334	35,840.50	0.11
344	002073	软控股份	3,155	35,809.25	0.11
345	002642	荣之联	1,780	35,778.00	0.11
346	002522	浙江众成	1,988	35,764.12	0.11

347	002161	远望谷	3,100	35,743.00	0.11
348	002238	天威视讯	2,424	35,511.60	0.11
349	002605	姚记扑克	2,093	35,329.84	0.11
350	002654	万润科技	3,200	35,328.00	0.11
351	002037	久联发展	2,063	35,318.56	0.11
352	002254	泰和新材	2,856	35,300.16	0.11
353	002226	江南化工	4,092	35,232.12	0.11
354	002614	蒙发利	2,639	35,204.26	0.11
355	002052	同洲电子	3,141	35,179.20	0.11
356	002140	东华科技	2,593	35,057.36	0.11
357	002363	隆基机械	2,800	35,000.00	0.11
358	002025	航天电器	1,388	34,977.60	0.11
359	002419	天虹商场	2,325	34,921.50	0.11
360	002233	塔牌集团	3,732	34,894.20	0.11
361	002378	章源钨业	3,558	34,832.82	0.11
362	002374	丽鹏股份	4,420	34,741.20	0.11
363	002365	永安药业	1,386	34,719.30	0.11
364	002404	嘉欣丝绸	3,838	34,695.52	0.11
365	002335	科华恒盛	808	34,663.20	0.11
366	002581	未名医药	1,422	34,511.94	0.11
367	002293	罗莱生活	2,565	34,499.25	0.11
368	002036	联创电子	1,800	34,488.00	0.11
369	002545	东方铁塔	3,095	34,478.30	0.11
370	002054	德美化工	3,131	34,315.76	0.11
371	002211	宏达新材	2,599	34,176.85	0.11
372	002692	远程电缆	2,880	33,926.40	0.11
373	002182	云海金属	1,818	33,832.98	0.11
374	002539	云图控股	3,052	33,755.12	0.11
375	002218	拓日新能	3,754	33,748.46	0.11
376	002396	星网锐捷	1,713	33,746.10	0.11
377	002011	盾安环境	3,544	33,738.88	0.11
378	002554	惠博普	4,106	33,546.02	0.11
379	002696	百洋股份	1,461	33,456.90	0.11
380	002320	海峡股份	2,133	33,296.13	0.11
381	002123	梦网荣信	2,170	32,550.00	0.10
382	002527	新时达	2,424	32,505.84	0.10
383	002535	林州重机	4,951	32,231.01	0.10
384	002063	远光软件	2,452	32,219.28	0.10
385	002516	旷达科技	4,900	32,144.00	0.10
386	002215	诺普信	2,900	32,132.00	0.10
387	002231	奥维通信	2,100	32,109.00	0.10
388	002134	天津普林	2,000	32,020.00	0.10
389	002587	奥拓电子	2,400	31,992.00	0.10
390	002028	思源电气	2,406	31,711.08	0.10

391	002280	联络互动	2,255	31,502.35	0.10
392	002193	山东如意	1,400	31,430.00	0.10
393	002360	同德化工	2,601	31,290.03	0.10
394	002600	江粉磁材	3,054	31,272.96	0.10
395	002316	键桥通讯	2,276	31,067.40	0.10
396	002495	佳隆股份	4,960	30,603.20	0.10
397	002667	鞍重股份	1,086	30,581.76	0.10
398	002309	中利科技	2,142	30,437.82	0.10
399	002016	世荣兆业	3,166	30,298.62	0.10
400	002591	恒大高新	1,700	29,988.00	0.09
401	002584	西陇科学	1,885	29,933.80	0.09
402	002325	洪涛股份	3,733	29,901.33	0.09
403	002327	富安娜	3,382	29,761.60	0.09
404	002300	太阳电缆	3,116	29,726.64	0.09
405	002391	长青股份	1,700	29,716.00	0.09
406	002494	华斯股份	2,146	29,700.64	0.09
407	002005	德豪润达	5,111	29,388.25	0.09
408	002312	三泰控股	3,350	29,312.50	0.09
409	002406	远东传动	3,436	29,274.72	0.09
410	002088	鲁阳节能	1,500	29,175.00	0.09
411	002350	北京科锐	1,400	29,162.00	0.09
412	002636	金安国纪	1,768	28,906.80	0.09
413	002184	海得控制	1,394	28,855.80	0.09
414	002445	中南文化	1,914	28,729.14	0.09
415	002578	闽发铝业	2,397	28,500.33	0.09
416	002457	青龙管业	2,400	27,864.00	0.09
417	002541	鸿路钢构	1,400	27,720.00	0.09
418	002440	闰土股份	1,693	27,663.62	0.09
419	002593	日上集团	3,746	27,570.56	0.09
420	002681	奋达科技	2,124	27,463.32	0.09
421	002298	中电鑫龙	1,988	27,454.28	0.09
422	002377	国创高新	2,966	27,227.88	0.09
423	002151	北斗星通	850	27,115.00	0.09
424	002441	众业达	2,018	27,000.84	0.09
425	002135	东南网架	3,671	26,724.88	0.08
426	002071	长城影视	1,951	26,611.64	0.08
427	002629	仁智股份	2,019	26,469.09	0.08
428	002255	海陆重工	3,022	26,382.06	0.08
429	002139	拓邦股份	1,983	26,155.77	0.08
430	002417	三元达	1,586	25,772.50	0.08
431	002504	弘高创意	3,173	25,098.43	0.08
432	002478	常宝股份	1,900	25,004.00	0.08
433	002295	精艺股份	1,385	24,971.55	0.08
434	002144	宏达高科	1,100	24,882.00	0.08



435	002471	中超控股	4,100	24,846.00	0.08
436	002307	北新路桥	2,900	24,360.00	0.08
437	002322	理工环科	971	23,168.06	0.07
438	002466	天齐锂业	700	22,715.00	0.07
439	002682	龙洲股份	1,600	22,368.00	0.07
440	002165	红宝丽	2,566	21,990.62	0.07
441	002160	常铝股份	2,300	21,942.00	0.07
442	002452	长高集团	2,300	21,620.00	0.07
443	002381	双箭股份	1,800	21,006.00	0.07
444	002631	德尔未来	1,128	20,946.96	0.07
445	002536	西泵股份	1,400	19,768.00	0.06
446	002580	圣阳股份	1,053	18,859.23	0.06
447	002358	森源电气	664	12,735.52	0.04

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002344	海宁皮城	2,405,687.00	9.80
2	002157	正邦科技	1,560,000.00	6.36
3	002477	雏鹰农牧	882,262.00	3.60
4	002465	海格通信	866,158.82	3.53
5	002236	大华股份	725,688.49	2.96
6	002673	西部证券	676,344.00	2.76
7	002415	海康威视	562,795.89	2.29
8	002664	信质电机	547,036.00	2.23
9	002370	亚太药业	543,967.94	2.22
10	002466	天齐锂业	522,516.00	2.13
11	002223	鱼跃医疗	472,792.00	1.93
12	002736	国信证券	462,784.00	1.89
13	002049	紫光国芯	453,595.10	1.85
14	002252	上海莱士	440,368.18	1.79
15	002183	怡亚通	435,298.00	1.77
16	002534	杭锅股份	412,143.00	1.68
17	002176	江特电机	379,000.00	1.54
18	002454	松芝股份	344,036.00	1.40
19	002303	美盈森	338,773.00	1.38
20	002663	普邦股份	337,436.00	1.37

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002344	海宁皮城	2,561,459.00	10.44
2	002157	正邦科技	1,673,041.20	6.82
3	002477	雏鹰农牧	897,929.20	3.66
4	002673	西部证券	698,195.00	2.84
5	002236	大华股份	690,297.00	2.81
6	002664	信质电机	610,560.60	2.49
7	002736	国信证券	574,464.81	2.34
8	002465	海格通信	563,722.00	2.30
9	002466	天齐锂业	461,458.00	1.88
10	002176	江特电机	447,273.33	1.82
11	002183	怡亚通	417,794.36	1.70
12	002454	松芝股份	407,818.21	1.66
13	002534	杭锅股份	405,374.00	1.65
14	002415	海康威视	404,463.02	1.65
15	002095	生意宝	376,538.50	1.53
16	002663	普邦股份	351,099.16	1.43
17	002303	美盈森	321,101.00	1.31
18	002714	牧原股份	273,563.00	1.11
19	002045	国光电器	240,604.00	0.98
20	002631	德尔未来	238,076.00	0.97

**8.4.3 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	27,195,713.65
卖出股票的收入（成交）总额	19,057,653.73

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

**8.11.2 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。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，以及经核实托管人提供的信息，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

**8.12.3 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	2,418.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	920.23
5	应收申购款	1,994,631.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,997,970.16

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名指数投资中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

### 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,269	23,635.18	2,880,581.00	9.60%	27,112,464.51	90.40%

**9.2 期末上市基金前十名持有人**

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张军	12,283,100.44	40.95%
2	中银保险有限公司—传统保险产品	2,796,973.00	9.33%
3	郑淑女	932,651.00	3.11%
4	李锦山	543,778.00	1.81%
5	王慧娟	457,275.14	1.52%
6	李妍	452,404.19	1.51%
7	司明辉	366,409.52	1.22%
8	朱洪宏	348,595.00	1.16%
9	张莉凤	333,721.53	1.11%
10	宗祥芬	261,605.37	0.87%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	502.16	0.00%

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

本报告期期初基金份额总额	12,020,101.89
本报告期基金总申购份额	1,640,620,227.74
减：本报告期基金总赎回份额	1,622,647,284.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,993,045.51

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 2016年6月25日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。自该日起刘轶先生担任我司督察长一职。公司总经理谭晓雨女士不再代为履行督察长职责。

2. 2016年8月19日,基金管理人发布《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》。增聘黄欣先生担任本基金的基金经理。

3. 2016年9月27日,基金管理人发布《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告》。冒浩先生不再担任本基金的基金经理。

4. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

本基金本报告期末支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为6.5万元人民币,目前该事务所已向本基金提供连续5年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	46,253,367.38	100.00%	42,150.90	100.00%	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

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

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 研究报告被基金采纳的情况；

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；

E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营

机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	公司网站	2016-01-04
2	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2016-01-06
3	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-06
4	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	公司网站	2016-01-07



5	国联安基金管理有限公司关于指数熔断后旗下基金调整开放时间的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-09
6	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持天龙集团股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-13
7	基金所持冠昊生物(300238)股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-14
8	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持千方科技(002373)股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-15
9	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持拓维信息、康得新股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-16
10	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)四季报	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-01-20
11	国联安基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-28
12	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持上海佳豪、暴风科技股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-28
13	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持宁波港等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-29
14	国联安基金管理有限公司关于增加奕丰科技服务(深圳)前海有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-29
15	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持创意信息股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-30
16	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万方发展、华信国际股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-01-30
17	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-02-18
18	基金所持信威集团股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-02-18
19	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持中茵股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-02-19
20	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加数米基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 深交所、公司网站	2016-02-23
21	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持慈文传媒等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-02-27
22	国联安基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限及最低持有金额下限的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-02-29
23	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-03-02

24	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持金亚科技股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-03-04
25	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加北京乐融多源投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-03-07
26	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持浦发银行股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-03-05
27	国联安基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-03-11
28	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持长安汽车等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-03-19
29	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2015年度报告摘要	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-03-28
30	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持完美环球(002624)估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-03-31
31	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持牧原股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-04-07
32	国联安基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-04-13
33	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2016年度第一季度报告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-04-22
34	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-04-25
35	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持汇冠股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-05-06
36	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-05-06
37	国联安基金管理有限公司关于旗下基金参加了联泰资产费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-05-09
38	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持惠博普等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-05-11
39	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持神州信息等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-05-13
40	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持康耐特等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-05-20
41	国联安基金管理有限公司关于增加北京微动利投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-06-03
42	国联安基金管理有限公司关于增加深圳富济	中国证券报、上证报、	2016-06-03

	财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告	证券时报、证券日报、 公司网站	
43	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持黑牛食品股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-06-04
44	基金所持东方国信股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-06-15
45	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持格力电器股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-06-24
46	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)分红公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-06-24
47	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-06-25
48	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-06-30
49	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持西王食品等股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-07-06
50	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站、深交所	2016-07-18
51	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2016 年度第二季度报告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-07-20
52	国联安基金管理有限公司关于增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-07-22
53	国联安基金管理有限公司关于开展网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-07-25
54	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持丰东股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-07-29
55	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持完美世界股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-07-30
56	国联安基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-08-09
57	国联安基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-08-12
58	国联安基金管理有限公司关于增加北京电盈基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-08-15

59	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	中国证券报、上证报、 证券时报、深交所、公 司网站	2016-08-19
60	国联安基金管理有限公司关于增加深圳前海微众银行股份有限公司为旗下国联安信心增长债券型证券投资基金 B 的代销机构并开通申购、赎回参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-08-19
61	国联安基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-08-19
62	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2016 年半年度报告摘要	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-08-26
63	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持德尔未来股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-09-03
64	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-09-20
65	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-09-27
66	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海利得基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-10-24
67	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)三季报	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-10-24
68	国联安基金管理有限公司关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 公司网站	2016-11-17
69	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-11-29
70	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持万家文化和中科创达股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-12-14
71	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持先导智能、中潜股份股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-12-16
72	国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持高新兴股票估值调整的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、公司网站	2016-12-20
73	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、 证券时报、证券日报、 深交所、公司网站	2016-12-22
74	国联安基金管理有限公司关于增加上海凯石	中国证券报、上证报、	2016-12-28

	财富基金销售有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告	证券时报、证券日报、深交所、公司网站	
75	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额投资业务并参加相关费率优惠活动的公告	中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、深交所、公司网站	2016-12-30

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双力中小板综指分级证券投资基金（现国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)）发行及募集的文件
- 2、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### 12.3 查阅方式

网址：[www.gtja-allianz.com](http://www.gtja-allianz.com)

国联安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日