

**国联安德盛小盘精选证券投资基金**  
**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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7  |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8  |
| 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.....              | 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.....             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12 |
| 4.6 管理人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.....                | 13 |
| 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.....       | 14 |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 14 |
| 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..... | 14 |
| 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.....                         | 15 |
| 6.2 注册会计师的责任.....                            | 15 |
| 6.3 审计意见.....                                | 16 |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | 16 |
| 7.1 资产负债表.....                               | 16 |
| 7.2 利润表.....                                 | 18 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 19 |
| 7.4 报表附注.....                                | 21 |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | 46 |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 46 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 47 |
| 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.....       | 48 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 51 |
| 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.....      | 52 |

|            |   |           |
|------------|---|-----------|
| 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 ..... | 52        |
| 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 ..... | 52        |
| 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 .....    | 52        |
| 8.10       | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....              | 52        |
| 8.11       | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....              | 52        |
| 8.12       | 投资组合报告附注 .....                          | 53        |
| <b>§9</b>  | <b>基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>54</b> |
| 9.1        | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 54        |
| 9.2        | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 54        |
| 9.3        | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....     | 54        |
| <b>§10</b> | <b>开放式基金份额变动</b> .....                  | <b>54</b> |
| <b>§11</b> | <b>重大事件揭示</b> .....                     | <b>55</b> |
| 11.1       | 基金份额持有人大会决议 .....                       | 55        |
| 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 .....       | 55        |
| 11.3       | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....            | 55        |
| 11.4       | 基金投资策略的改变 .....                         | 55        |
| 11.5       | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                  | 55        |
| 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 .....          | 55        |
| 11.7       | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                 | 55        |
| 11.8       | 其他重大事件 .....                            | 58        |
| <b>§12</b> | <b>备查文件目录</b> .....                     | <b>63</b> |
| 12.1       | 备查文件目录 .....                            | 63        |
| 12.2       | 存放地点 .....                              | 63        |
| 12.3       | 查阅方式 .....                              | 63        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 国联安德盛小盘精选证券投资基金    |
| 基金简称       | 国联安小盘精选混合          |
| 基金主代码      | 257010             |
| 交易代码       | 257010             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2004 年 4 月 12 日    |
| 基金管理人      | 国联安基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,361,512,053.00 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金是一只积极成长型股票基金，专注投资于中国 A 股市场上具有成长潜力的小盘股。基金管理人将充分利用国内外成功的基金管理经验，在严格的风险控制机制下，采用积极主动的投资策略，通过多角度、多层次的基本面研究，充分发掘小盘股所具有的潜在成长性带来的投资机会，并通过波段操作的择时策略追求较高的资本利得收益，从而实现投资者资产的长期增值。  |
| 投资策略 | 本基金的投资管理主要分为两个层次：第一个层次是自下而上的证券选择。总体上说，对于本基金的投资重点——小盘股而言，将采取自下而上的方式，综合使用数量化的金融工程模型、科学严谨的财务分析和深入的上市公司调研与独特的草根研究等多种手段精选个股，并在此基础上构建股票投资组合。第二个层次是资产类别配置层面的风险管理，即对基金资产在股票、债券和现金三大资产类别间的配置进行实时监控，并根据当时的宏观经济形势和证券市场行情调整资产配置比例，达到控制基金风险的目的。总之，本基金在投资管理的每一个层次都将定性研究和量化分析有机地结合起来，从而保证投资决策的科学性与风险收益结构的最优性。 |

|        |   |
|--------|---|
| 业绩比较基准 | (天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%)×60%+上证国债指数×40%  |
| 风险收益特征 | 本基金是一只积极成长型的股票基金，由于其股票投资组合以小盘股为主，本基金的风险与预期收益都要高于平衡型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争使基金的单位风险收益值从长期平均来看高于业绩比较基准的单位风险收益值。 |

### 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                       | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 陆康芸                               | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38992806                      | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | customer.service@gtja-allianz.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-38784766/4007000365           | 95588               |
| 传真          |      | 021-50151582                      | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼     | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼     | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码        |      | 200121                            | 100140              |
| 法定代表人       |      | 虞启斌                               | 易会满                 |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报、上海证券报、证券时报  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.gtja-allianz.com">http://www.gtja-allianz.com</a> |
| 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 | 国联安基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼 |

## §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

| <b>3.1.1 期间数据和指标</b> | <b>2016 年</b>    | <b>2015 年</b>    | <b>2014 年</b>    |
|----------------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期已实现收益              | 13,079,780.54    | 1,111,663,247.02 | 289,008,856.75   |
| 本期利润                 | -181,973,554.21  | 980,583,701.07   | 588,965,919.51   |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.1470          | 0.7112           | 0.2976           |
| 本期加权平均净值利润率          | -11.27%          | 47.79%           | 32.88%           |
| 本期基金份额净值增长率          | -9.41%           | 56.35%           | 37.53%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2016 年末</b>   | <b>2015 年末</b>   | <b>2014 年末</b>   |
| 期末可供分配利润             | 59,520,278.86    | 802,054,293.35   | 63,715,460.47    |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0437           | 0.6966           | 0.0337           |
| 期末基金资产净值             | 1,421,032,331.86 | 1,953,435,261.22 | 2,105,561,950.92 |
| 期末基金份额净值             | 1.044            | 1.697            | 1.114            |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2016 年末</b>   | <b>2015 年末</b>   | <b>2014 年末</b>   |
| 基金份额累计净值增长率          | 421.63%          | 475.78%          | 268.27%          |

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。

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      | -0.19%   | 0.59%       | 0.04%      | 0.51%         | -0.23%  | 0.08% |
| 过去六个月      | 4.16%    | 0.69%       | 1.88%      | 0.55%         | 2.28%   | 0.14% |
| 过去一年       | -9.41%   | 1.36%       | -7.64%     | 1.09%         | -1.77%  | 0.27% |
| 过去三年       | 94.80%   | 1.72%       | 50.15%     | 1.19%         | 44.65%  | 0.53% |
| 过去五年       | 133.42%  | 1.54%       | 69.63%     | 1.06%         | 63.79%  | 0.48% |
| 自基金合同生效起至今 | 421.63%  | 1.44%       | 227.60%    | 1.18%         | 194.03% | 0.26% |

注：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

##### 国联安德盛小盘精选证券投资基金

自基金合同生效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  
(2004 年 4 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：1、本基金业绩比较基准为（天相小盘股指数×60%+天相中盘股指数×40%）×60%+上证国



债指数×40%；

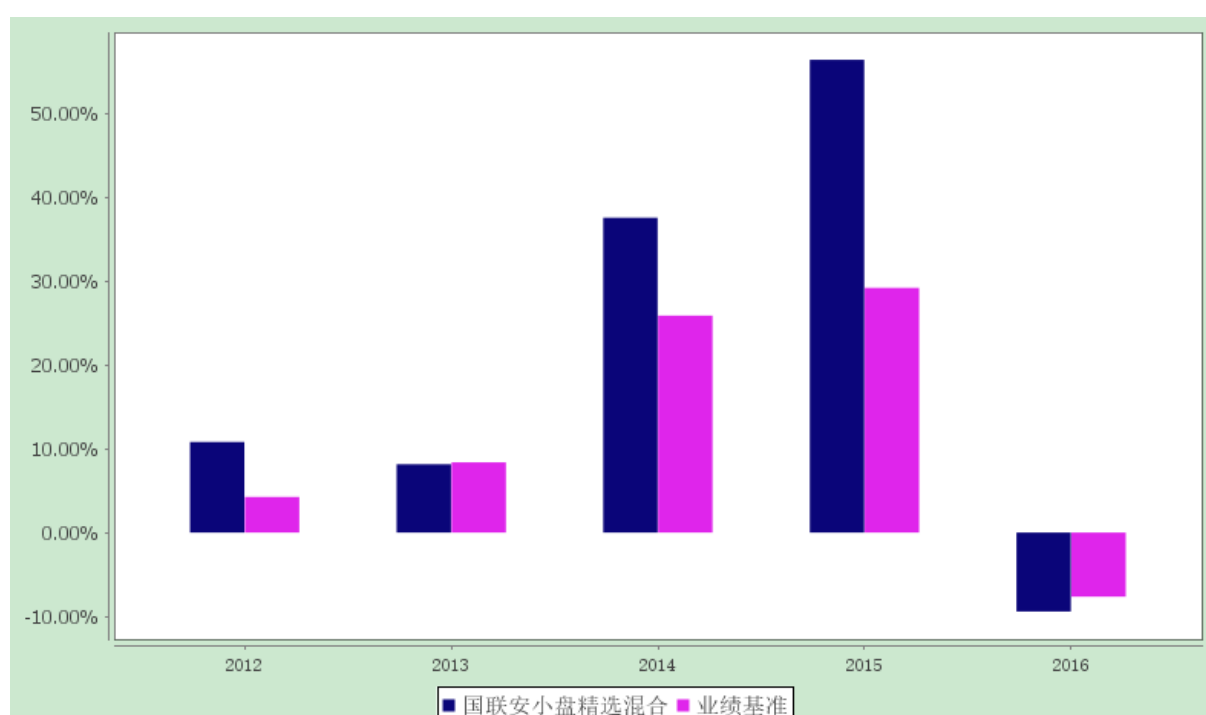
2、本基金基金合同于 2004 年 4 月 12 日生效。本基金建仓期自基金合同生效之日起 6 个月，建仓期结束时除小盘股投资比例低于合同规定的范围外，其他各项资产配置符合合同约定；

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。

### 3.2.3 过去五年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

国联安德盛小盘精选证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：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 | 5.000       | 596,348,713.31 | 281,826,210.22 | 878,174,923.53 | -  |
| 2015 | 0.310       | 30,044,047.51  | 28,986,696.33  | 59,030,743.84  | -  |
| 2014 | -           | -              | -              | -              | -  |
| 合计   | 5.310       | 626,392,760.82 | 310,812,906.55 | 937,205,667.37 | -  |

注：2016 年度利润分配的收益基准日为 2015 年 12 月 31 日，2015 年度利润分配的收益基准日为 2014 年 12 月 31 日。

## §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 |                 |  |
| 邹新进 | 本基金基金经理、投资组合管理部总监 | 2010-03-06      | -    | 12 年(自 2004 年起) | 邹新进先生,硕士.于 2004 年 7 月加盟中信建投证券有限责任公司(前身为华夏证券有限责任公司)任分析师。2007 年 7 月加入国联安基金管理有限公司,历任高级研究员、基金经理助理；现担任研究部副总监、投资组合管理部总监,2010 年 3 月起担任国联安德盛小盘精选证券投资基金基金经理。2012 年 2 月至 2013 年 4 月兼任国联安信心增长定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |

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》、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》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 年我国证券市场继续动荡并释放风险。年初中国股市熔断机制实行,股市瞬间开始暴跌,股灾再次出现,但同时也释放了 2015 年隐藏的部分风险。2 月份之后,股市开始稳步缓慢回升。年底,债市出现暴跌,流动性危机短暂出现。整体上,2016 年是释放风险的一年。

本基金 2016 年整体表现尚可。本基金报告期内在仓位上保持较高仓位,并以稳定品种为主,在年初股灾期间损失较少。在行业配置上,本基金主要按照年初的投资思路重点配置在稳定增长的医药板块、景气较好的农化板块以及估值较低的汽车板块,相对来说,亏损较小;期间也参与了供给侧改革等热点板块的配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-9.41%,同期业绩比较基准收益率为-7.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年,本基金管理人认为有两点值得关注:一是通胀是否明显抬头;二是改革措施(包括资本市场)的实质性实施,如供给侧改革等。

对于市场策略,本基金管理人认为,2017 年宏观经济可能先高后低,宽松的资金和政策环境已有所转向,因而,股市上半年可能机会更大。同时,A 股市场中短期内仍呈现典型的存量资金博弈特征,并与全球市场关联度很小。

在行业配置上,本基金重点以稳定的医药板块、低估值的汽车行业和农业板块为主,同时加大

周期板块和混改概念的配置。

本基金管理人坚信，通过勤勉尽职的工作，持续挖掘优质上市公司进行长期投资，我们会为持有人带来中长期优厚的投资回报，来分享中国经济持续快速成长的成果。

#### 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 2015 年 12 月 31 日的可供分配利润为基准，于 2016 年 9 月 1 日实施分红，向截止至 2016 年 8 月 31 日在本基金注册登记人国联安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额 5.000 元派发红利。共发放红利 878,174,923.53 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

无

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国联安德盛小盘精选证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，国联安德盛小盘精选证券投资基金的管理人——国联安基金管理有限公司在国联安德盛小盘精选证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国联安德盛小盘精选证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 878,174,923.53 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

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的国联安德盛小盘精选证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 1700462 号

国联安德盛小盘精选证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的国联安德盛小盘精选证券投资基金（以下简称“国联安德盛小盘基金”）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德盛小盘基金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，国联安德盛小盘基金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，公允反映了国联安德盛小盘基金 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：国联安德盛小盘精选证券投资基金

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<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：      |         | -                       | -                        |
| 银行存款     | 7.4.7.1 | 44,738,797.67           | 39,669,634.75            |
| 结算备付金    |         | 711,222.78              | 1,925,289.49             |
| 存出保证金    |         | 294,419.50              | 646,916.51               |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 1,378,554,555.41        | 1,909,238,063.61         |
| 其中：股票投资  |         | 1,065,268,681.61        | 1,455,541,412.21         |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 313,285,873.80          | 453,696,651.40           |
| 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         |            | 1,461,090.08               | 169,562.54                  |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 3,144,892.69               | 4,675,618.52                |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | 29,060.17                  | 5,109,987.54                |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>1,428,934,038.30</b>    | <b>1,961,435,072.96</b>     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2015年12月31日</b> |
| 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         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | 3,530,854.98               | 2,425,212.45                |
| 应付管理人报酬         |            | 1,940,985.04               | 2,566,527.30                |
| 应付托管费           |            | 323,497.50                 | 427,754.54                  |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 567,531.04                 | 1,043,187.36                |
| 应交税费            |            | 1,132,463.60               | 1,132,463.60                |
| 应付利息            |            | -                          | -                           |
| 应付利润            |            | -                          | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                          | -                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 406,374.28                 | 404,666.49                  |
| <b>负债合计</b>     |            | <b>7,901,706.44</b>        | <b>7,999,811.74</b>         |
| <b>所有者权益：</b>   |            | -                          | -                           |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 1,361,512,053.00           | 1,151,380,967.87            |

|                   |          |                         |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | 59,520,278.86           | 802,054,293.35          |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>1,421,032,331.86</b> | <b>1,953,435,261.22</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>1,428,934,038.30</b> | <b>1,961,435,072.96</b> |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.044 元，基金份额总额 1,361,512,053.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国联安德盛小盘精选证券投资基金

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<br>2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>           |          | <b>-148,504,361.82</b>              | <b>1,026,410,920.72</b>             |
| 1.利息收入                |          | 13,509,667.61                       | 15,427,499.03                       |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 518,639.55                          | 641,603.39                          |
| 债券利息收入                |          | 12,617,647.30                       | 14,320,461.09                       |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入            |          | 373,380.76                          | 465,434.55                          |
| 其他利息收入                |          | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 31,588,839.34                       | 1,140,654,189.51                    |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | 18,673,238.69                       | 1,027,069,148.31                    |
| 基金投资收益                |          | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | -8,329.95                           | 94,986,901.09                       |
| 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 | 12,923,930.60                       | 18,598,140.11                       |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -195,053,334.75                     | -131,079,545.95                     |

|                            |          |                        |                       |
|----------------------------|----------|------------------------|-----------------------|
| 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 | 1,450,465.98           | 1,408,778.13          |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>33,469,192.39</b>   | <b>45,827,219.65</b>  |
| 1. 管理人报酬                   |          | 24,299,720.07          | 30,638,222.36         |
| 2. 托管费                     |          | 4,049,953.39           | 5,106,370.29          |
| 3. 销售服务费                   |          | -                      | -                     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18 | 4,599,924.22           | 8,168,756.44          |
| 5. 利息支出                    |          | 100,712.71             | 1,493,988.56          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 100,712.71             | 1,493,988.56          |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19 | 418,882.00             | 419,882.00            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-181,973,554.21</b> | <b>980,583,701.07</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                      | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-181,973,554.21</b> | <b>980,583,701.07</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安德盛小盘精选证券投资基金

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<br>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）                 | 1,151,380,967.87                       | 802,054,293.35  | 1,953,435,261.22 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）        | -                                      | -181,973,554.21 | -181,973,554.21  |
| 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 | 210,131,085.13                         | 317,614,463.25  | 527,745,548.38   |

|  |                       |                 |                   |
|--|-----------------------|-----------------|-------------------|
| 列)                                     |                       |                 |                   |
| 其中：1.基金申购款                             | 1,376,763,468.69      | 595,632,523.97  | 1,972,395,992.66  |
| 2.基金赎回款                                | -1,166,632,383.56     | -278,018,060.72 | -1,444,650,444.28 |
| 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） | -                     | -878,174,923.53 | -878,174,923.53   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,361,512,053.00      | 59,520,278.86   | 1,421,032,331.86  |
| 项目                                     | 上年度可比期间               |                 |                   |
|  | 2015年1月1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）                        | 1,890,018,350.56      | 215,543,600.36  | 2,105,561,950.92  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                     | 980,583,701.07  | 980,583,701.07    |
| 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）      | -738,637,382.69       | -335,042,264.24 | -1,073,679,646.93 |
| 其中：1.基金申购款                             | 793,677,654.75        | 411,611,405.02  | 1,205,289,059.77  |
| 2.基金赎回款                                | -1,532,315,037.44     | -746,653,669.26 | -2,278,968,706.70 |
| 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） | -                     | -59,030,743.84  | -59,030,743.84    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,151,380,967.87      | 802,054,293.35  | 1,953,435,261.22  |

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

国联安德盛小盘精选证券投资基金（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”）《关于同意德盛小盘精选证券投资基金设立的批复》（证监基金字 [2004] 19 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》及其配套规则和《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2004 年 4 月 12 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 8,324,975,786.82 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》和《国联安德盛小盘精选证券投资基金招募说明书（更新）》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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票资产 20%-75%；债券资产 20%-65%；现金类资产 5%-15%。本基金的业绩比较基准为： $(60\% \times \text{天相小盘股指数} + 40\% \times \text{天相中盘股指数}) \times 60\% + \text{上证国债指数} \times 40\%$ 。

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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用现金分红或红利再投资方式，基金份额持有人可选择现金分红或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，基金份额持有人事先未做出选择的，本基金默认的收益分配方式为现金分红。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年至少 1 次，年度收益分配比例不低于该年度基金净收益的 90%。但若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配。如果基金投资当年出现净亏损，则不进行收益分配。基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

#### 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》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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

(c) 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。

(2) 应交税费

债券利息收入所得税:2016 年 12 月 31 日 1,132,463.60 元

2015 年 12 月 31 日 1,132,463.60 元

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

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<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 44,738,797.67           | 39,669,634.75            |
| 定期存款 | -                       | -                        |
| 其他存款 | -                       | -                        |
| 合计   | 44,738,797.67           | 39,669,634.75            |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日  |                  |                |
|---------------|-------|--------------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 979,157,249.18           | 1,065,268,681.61 | 86,111,432.43  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 311,627,009.00           | 306,065,873.80   | -5,561,135.20  |
|               | 银行间市场 | 6,993,464.11             | 7,220,000.00     | 226,535.89     |
|               | 合计    | 318,620,473.11           | 313,285,873.80   | -5,334,599.31  |
| 资产支持证券        |       | -                        | -                | -              |
| 基金            |       | -                        | -                | -              |
| 其他            |       | -                        | -                | -              |
| 合计            |       | 1,297,777,722.29         | 1,378,554,555.41 | 80,776,833.12  |
| 项目            |       | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                  |                |
|               |       | 成本                       | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 1,188,471,297.31         | 1,455,541,412.21 | 267,070,114.90 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                        | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场 | 385,958,751.72           | 394,125,651.40   | 8,166,899.68   |
|               | 银行间市场 | 58,977,846.71            | 59,571,000.00    | 593,153.29     |
|               | 合计    | 444,936,598.43           | 453,696,651.40   | 8,760,052.97   |
| 资产支持证券        |       | -                        | -                | -              |
| 基金            |       | -                        | -                | -              |
| 其他            |       | -                        | -                | -              |
| 合计            |       | 1,633,407,895.74         | 1,909,238,063.61 | 275,830,167.87 |

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日）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（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日）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（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日）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<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 8,044.49                | 11,785.85                |
| 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  | 352.00                  | 953.04                   |
| 应收债券利息     | 3,136,350.45            | 4,662,559.42             |
| 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         | 145.75                  | 320.21                   |
| 合计         | 3,144,892.69            | 4,675,618.52             |

注：此处其他列示基金存于上交所与深交所的权证交易保证金的期末应收利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末（2016 年 12 月 31 日）及上年度末（2015 年 12 月 31 日）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 | 567,391.04       | 1,042,912.36     |
| 银行间市场应付交易费用 | 140.00           | 275.00           |
| 合计          | 567,531.04       | 1,043,187.36     |

#### 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       | 6,374.28         | 4,666.49         |
| 其他应付款       | -                | -                |
| 预提费用        | -                | -                |
| 银行手续费       | -                | -                |
| 应付后端申购费     | -                | -                |
| 信息披露费用      | 300,000.00       | 300,000.00       |
| 审计费用        | 100,000.00       | 100,000.00       |
| 合计          | 406,374.28       | 404,666.49       |

#### 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          | 1,151,380,967.87                 | 1,151,380,967.87  |
| 本期申购          | 1,376,763,468.69                 | 1,376,763,468.69  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,166,632,383.56                | -1,166,632,383.56 |
| 本期末           | 1,361,512,053.00                 | 1,361,512,053.00  |

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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           | 931,930,394.84  | -129,876,101.49 | 802,054,293.35  |
| 本期利润           | 13,079,780.54   | -195,053,334.75 | -181,973,554.21 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 369,893,098.48  | -52,278,635.23  | 317,614,463.25  |
| 其中：基金申购款       | 967,279,828.73  | -371,647,304.76 | 595,632,523.97  |
| 基金赎回款          | -597,386,730.25 | 319,368,669.53  | -278,018,060.72 |
| 本期已分配利润        | -878,174,923.53 | -               | -878,174,923.53 |
| 本期末            | 436,728,350.33  | -377,208,071.47 | 59,520,278.86   |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|-----------|----------------------------------|----------------------------------|
|           | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入  | 434,328.66                       | 553,488.47                       |
| 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 | 31,088.97                        | 61,953.53                        |
| 其他        | 53,221.92                        | 26,161.39                        |
| 合计        | 518,639.55                       | 641,603.39                       |

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所权证交易保证金利息以及基金申购款滞留利息。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                               | 上年度可比期间                          |
|------------|----------------------------------|----------------------------------|
|            | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
| 卖出股票成交总额   | 1,603,443,467.07                 | 3,095,688,221.21                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,584,770,228.38                 | 2,068,619,072.90                 |
| 买卖股票差价收入   | 18,673,238.69                    | 1,027,069,148.31                 |

### 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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                              | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31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 | -8,329.95             | 94,986,901.09         |
| 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                           | -8,329.95             | 94,986,901.09         |

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 403,827,369.02        | 886,662,385.52        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 397,454,985.06        | 781,356,554.87        |
| 减：应收利息总额               | 6,380,713.91          | 10,318,929.56         |
| 买卖债券差价收入               | -8,329.95             | 94,986,901.09         |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

### 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                    | 上年度可比期间               |
|----|-----------------------|-----------------------|
|    | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |



|             |               |               |
|-------------|---------------|---------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 12,923,930.60 | 18,598,140.11 |
| 基金投资产生的股利收益 | -             | -             |
| 合计          | 12,923,930.60 | 18,598,140.11 |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------|-----------------------|-----------------------|
|            | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 1.交易性金融资产  | -195,053,334.75       | -131,079,545.95       |
| ——股票投资     | -180,958,682.47       | -49,909,671.05        |
| ——债券投资     | -14,094,652.28        | -81,169,874.90        |
| ——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         | -195,053,334.75       | -131,079,545.95       |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | 1,443,542.60          | 1,364,730.36          |
| 转换费收入   | 6,923.38              | 44,047.77             |
| 其他      | -                     | -                     |
| 合计      | 1,450,465.98          | 1,408,778.13          |

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                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 4,599,924.22          | 8,168,256.44          |
| 银行间市场交易费用 | -                     | 500.00                |
| 合计        | 4,599,924.22          | 8,168,756.44          |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|---------|-----------------------|-----------------------|
|         | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 审计费用    | 100,000.00            | 100,000.00            |
| 信息披露费   | 300,000.00            | 300,000.00            |
| 银行划款手续费 | 882.00                | 1,882.00              |
| 账户维护费   | 18,000.00             | 18,000.00             |
| 其他      | -                     | -                     |
| 合计      | 418,882.00            | 419,882.00            |

#### 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，本基金未发生需要披露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         |
| 中国工商银行股份有限公司(“工商银行”) | 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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                        | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期股票成交总额的比例 |
| 国泰君安  | -                           | -            | 52,118,221.56                    | 1.04%        |

**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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |              |
|-------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|--------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                             | 占当期债券成交总额的比例 |
| 国泰君安  | -                           | -            | 113,866,912.11                   | 7.88%        |

**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**

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |       |          |        |
|-------|-----------------------------|-------|----------|--------|
|       | 当期                          | 占当期佣金 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 |

|       | 佣金                               | 总量的比例          |           | 金总额的比例           |
|-------|----------------------------------|----------------|-----------|------------------|
| 国泰君安  | -                                | -              | -         | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |                |           |                  |
|       | 当期<br>佣金                         | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额  | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 国泰君安  | 48,455.78                        | 1.07%          | 44,890.01 | 4.30%            |

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用国泰君安证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从国泰君安获得证券研究综合服务。

#### 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<br>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 24,299,720.07                   | 30,638,222.36                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,047,481.53                    | 2,729,478.99                         |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,049,953.39                    | 5,106,370.29                         |

注：支付基金托管人工商银行的基金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。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

#### 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，本基金均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

份额单位：份

| 项目                | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 期初持有的基金份额         | 3,588,657.57          | -                     |
| 期间申购/买入总份额        | -                     | 3,588,657.57          |
| 期间因拆分变动份额         | -                     | -                     |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | 3,588,657.57          | -                     |
| 期末持有的基金份额         | 0.00                  | 3,588,657.57          |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                     | 0.31%                 |

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

##### 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

报告期末及上年度末，除基金管理人之外的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                    |        | 上年度可比期间               |        |
|-------|-----------------------|--------|-----------------------|--------|
|       | 2016年1月1日至2016年12月31日 |        | 2015年1月1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 |
|       |                       |        |                       |        |

|      |               |            |               |            |
|------|---------------|------------|---------------|------------|
| 工商银行 | 44,738,797.67 | 434,328.66 | 39,669,634.75 | 553,488.47 |
|------|---------------|------------|---------------|------------|

注：本基金通过“工商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 日的相关余额为人民币 711,222.78 元。(2015 年 12 月 31 日：人民币 1,925,289.49 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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均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

本报告期内及上年度可比期间，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  | 2016-08-31 | -   | 2016-08-31 | 5.000         | 596,348,713.31 | 281,826,210.22 | 878,174,923.53 | -  |
| 合计 |            |     |            | 5.000         | 596,348,713.31 | 281,826,210.22 | 878,174,923.53 | -  |

注：本期利润分配的收益基准日为 2015 年 12 月 31 日。

#### 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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 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 | 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 |
|                      |      |       |      |       |      |        |          |        |        |    |

|        |      |            |            | 型     |       |        |        |            |              |   |
|--------|------|------------|------------|-------|-------|--------|--------|------------|--------------|---|
| 300591 | 万里马  | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 新股待上市 | 3.07  | 3.07   | 2,397  | 7,358.79   | 7,358.79     | - |
| 603032 | 德新交运 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 新股待上市 | 5.81  | 5.81   | 1,628  | 9,458.68   | 9,458.68     | - |
| 603035 | 常熟汽饰 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 新股待上市 | 10.44 | 10.44  | 2,316  | 24,179.04  | 24,179.04    | - |
| 603186 | 华正新材 | 2016-12-26 | 2017-01-03 | 新股待上市 | 5.37  | 5.37   | 1,874  | 10,063.38  | 10,063.38    | - |
| 603228 | 景旺电子 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 新股待上市 | 23.16 | 23.16  | 3,491  | 80,851.56  | 80,851.56    | - |
| 603266 | 天龙股份 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 新股待上市 | 14.63 | 14.63  | 1,562  | 22,852.06  | 22,852.06    | - |
| 603689 | 皖天然气 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 新股待上市 | 7.87  | 7.87   | 4,818  | 37,917.66  | 37,917.66    | - |
| 603823 | 百合花  | 2016-12-09 | 2017-12-20 | 新股锁定  | 10.60 | 32.74  | 36,764 | 389,698.40 | 1,203,653.36 | - |
| 603877 | 太平鸟  | 2016-12-29 | 2017-01-09 | 新股待上市 | 21.30 | 21.30  | 3,180  | 67,734.00  | 67,734.00    | - |
| 002838 | 道恩股份 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 新股待上市 | 15.28 | 15.28  | 682    | 10,420.96  | 10,420.96    | - |
| 002840 | 华统股份 | 2016-12-29 | 2017-01-10 | 新股待上市 | 6.55  | 6.55   | 1,814  | 11,881.70  | 11,881.70    | - |
| 300508 | 维宏股份 | 2016-04-12 | 2017-04-19 | 新股锁定  | 20.08 | 121.49 | 10,383 | 208,490.64 | 1,261,430.67 | - |
| 300583 | 赛托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 新股待上市 | 40.29 | 40.29  | 1,582  | 63,738.78  | 63,738.78    | - |
| 300586 | 美联新材 | 2016-12-26 | 2017-01-04 | 新股待上市 | 9.30  | 9.30   | 1,006  | 9,355.80   | 9,355.80     | - |
| 300587 | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 新股待上  | 14.11 | 14.11  | 1,438  | 20,290.18  | 20,290.18    | - |

|        |      |            |            |       |      |      |       |          |          |   |
|--------|------|------------|------------|-------|------|------|-------|----------|----------|---|
|        |      |            |            | 市     |      |      |       |          |          |   |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 新股待上市 | 4.94 | 4.94 | 1,380 | 6,817.20 | 6,817.20 | - |

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 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       | 复牌开盘单盘价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|---------|--------------|---------------|---------------|----|
| 603308 | 应流股份 | 2016-11-24 | 重大事项 | 21.92  | 2017-02-14 | 21.92   | 805,700.00   | 16,594,539.49 | 17,660,944.00 |    |
| 002159 | 三特索道 | 2016-12-29 | 重大事项 | 32.00  | 2017-01-06 | 31.60   | 1,183,000.00 | 30,397,169.67 | 37,856,000.00 |    |
| 300420 | 五洋科技 | 2016-12-13 | 重大事项 | 24.98  | 2017-03-23 | 27.48   | 800,000.00   | 19,676,573.37 | 19,984,000.00 |    |

#### 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为 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为 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等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年末<br>2015年12月31日 |
|--------|--------------------|--------------------|
| AAA    | 136,642,717.40     | 217,628,501.40     |
| AAA 以下 | 7,220,000.00       | 9,456,000.00       |
| 未评级    | -                  | -                  |
| 合计     | 143,862,717.40     | 227,084,501.40     |

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资；

2、根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用 AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC 和 C 表示，其中，除 AAA 级、CCC 级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

#### 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<br>2016年12月<br>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                     |               |       |                |               |               |                  |                  |
| 其他资产                   | -             | -     | -              | -             | -             | -                | -                |
| 银行存款                   | 44,738,797.67 | -     | -              | -             | -             | -                | 44,738,797.67    |
| 结算备付金                  | 711,222.78    | -     | -              | -             | -             | -                | 711,222.78       |
| 存出保证金                  | 294,419.50    | -     | -              | -             | -             | -                | 294,419.50       |
| 交易性金融资产                | -             | -     | 220,538,888.00 | 38,795,000.00 | 53,951,985.80 | 1,065,268,681.61 | 1,378,554,555.41 |
| 应收证券清算款                | -             | -     | -              | -             | -             | 1,461,090.08     | 1,461,090.08     |
| 应收利息                   | -             | -     | -              | -             | -             | 3,144,892.69     | 3,144,892.69     |
| 应收股利                   | -             | -     | -              | -             | -             | -                | -                |
| 应收申购款                  | 99.40         | -     | -              | -             | -             | 28,960.77        | 29,060.17        |
| 资产总计                   | 45,744,539.35 | -     | 220,538,888.00 | 38,795,000.00 | 53,951,985.80 | 1,069,903,625.15 | 1,428,934,038.30 |
| 负债                     |               |       |                |               |               |                  |                  |
| 其他负债                   | -             | -     | -              | -             | -             | 406,374.28       | 406,374.28       |
| 卖出回购金融资产款              | -             | -     | -              | -             | -             | -                | -                |
| 应付证券清算款                | -             | -     | -              | -             | -             | -                | -                |
| 应付赎回款                  | -             | -     | -              | -             | -             | 3,530,854.98     | 3,530,854.98     |
| 应付管理人报酬                | -             | -     | -              | -             | -             | 1,940,985.04     | 1,940,985.04     |
| 应付托管费                  | -             | -     | -              | -             | -             | 323,497.50       | 323,497.50       |
| 应付交易费用                 | -             | -     | -              | -             | -             | 567,531.04       | 567,531.04       |
| 应交税费                   | -             | -     | -              | -             | -             | 1,132,463.60     | 1,132,463.60     |
| 应付利息                   | -             | -     | -              | -             | -             | -                | -                |

|                             |               |        |                |                |                |                  |                  |
|-----------------------------|---------------|--------|----------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
| 负债总计                        | -             | -      | -              | -              | -              | 7,901,706.4<br>4 | 7,901,706.4<br>4 |
| 利率敏感度缺口                     | 45,744,539.35 | -      | 220,538,888.00 | 38,795,000.00  | 53,951,985.80  | 1,062,001,918.71 | 1,421,032,331.86 |
| 上年度末<br>2015 年 12 月<br>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                          |               |        |                |                |                |                  |                  |
| 其他资产                        | -             | -      | -              | -              | -              | -                | -                |
| 银行存款                        | 39,669,634.75 | -      | -              | -              | -              | -                | 39,669,634.75    |
| 结算备付金                       | 1,925,289.49  | -      | -              | -              | -              | -                | 1,925,289.49     |
| 存出保证金                       | 646,916.51    | -      | -              | -              | -              | -                | 646,916.51       |
| 交易性金融资产                     | -             | -      | 183,826,048.00 | 153,782,603.40 | 116,088,000.00 | 1,455,541,412.21 | 1,909,238,063.61 |
| 应收证券清算款                     | -             | -      | -              | -              | -              | 169,562.54       | 169,562.54       |
| 应收利息                        | -             | -      | -              | -              | -              | 4,675,618.52     | 4,675,618.52     |
| 应收股利                        | -             | -      | -              | -              | -              | -                | -                |
| 应收申购款                       | 4,999,000.00  | -      | -              | -              | -              | 110,987.54       | 5,109,987.54     |
| 资产总计                        | 47,240,840.75 | -      | 183,826,048.00 | 153,782,603.40 | 116,088,000.00 | 1,460,497,580.81 | 1,961,435,072.96 |
| 负债                          |               |        |                |                |                |                  |                  |
| 其他负债                        | -             | -      | -              | -              | -              | 404,666.49       | 404,666.49       |
| 卖出回购金融资产款                   | -             | -      | -              | -              | -              | -                | -                |
| 应付证券清算款                     | -             | -      | -              | -              | -              | -                | -                |
| 应付赎回款                       | -             | -      | -              | -              | -              | 2,425,212.45     | 2,425,212.45     |
| 应付管理人报酬                     | -             | -      | -              | -              | -              | 2,566,527.30     | 2,566,527.30     |
| 应付托管费                       | -             | -      | -              | -              | -              | 427,754.54       | 427,754.54       |
| 应付交易费用                      | -             | -      | -              | -              | -              | 1,043,187.3      | 1,043,187.3      |

|         |               |   |                |                |                |                  |                  |
|---------|---------------|---|----------------|----------------|----------------|------------------|------------------|
|         |               |   |                |                |                | 6                | 6                |
| 应交税费    | -             | - | -              | -              | -              | 1,132,463.60     | 1,132,463.60     |
| 应付利息    | -             | - | -              | -              | -              | -                | -                |
| 负债总计    | -             | - | -              | -              | -              | 7,999,811.74     | 7,999,811.74     |
| 利率敏感度缺口 | 47,240,840.75 | - | 183,826,048.00 | 153,782,603.40 | 116,088,000.00 | 1,452,497,769.07 | 1,953,435,261.22 |

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                          |
|----|--------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                    | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 增加 1,932,343.13                 | 增加 2,634,839.11          |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | 减少 1,932,343.13                 | 减少 2,634,839.11          |

#### 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 74.96%，债券投资为 22.05%，无衍生金融资产。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<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                          |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 1,065,268,681.61        | 74.96                    | 1,455,541,412.21         | 74.51                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                        |
| 交易性金融资产—债券投资  | 313,285,873.80          | 22.05                    | 453,696,651.40           | 23.23                    |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                       | -                        | -                        | -                        |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                       | -                        | -                        | -                        |
| 合计            | 1,378,554,555.41        | 97.01                    | 1,909,238,063.61         | 97.74                    |

## 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加 85,392,588.04                | 增加 140,835,874.31        |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 减少 85,392,588.04                | 减少 140,835,874.31        |

## §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<br>的比例 (%) |
|----|-------|------------------|-------------------|
| 1  | 权益投资  | 1,065,268,681.61 | 74.55             |
|    | 其中：股票 | 1,065,268,681.61 | 74.55             |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 固定收益投资            | 313,285,873.80   | 21.92  |
|   | 其中：债券             | 313,285,873.80   | 21.92  |
|   | 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      | 45,450,020.45    | 3.18   |
| 7 | 其他各项资产            | 4,929,462.44     | 0.34   |
| 8 | 合计                | 1,428,934,038.30 | 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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 87,200,400.00  | 6.14         |
| B  | 采矿业              | 10,619,903.19  | 0.75         |
| C  | 制造业              | 629,911,349.21 | 44.33        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 37,917.66      | 0.00         |
| E  | 建筑业              | 42,939,000.00  | 3.02         |
| F  | 批发和零售业           | 179,215,530.00 | 12.61        |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 9,458.68       | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 64,697,122.87  | 4.55         |
| J  | 金融业              | -              | -            |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| K | 房地产业          | 12,782,000.00    | 0.90  |
| L | 租赁和商务服务业      | -                | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    | -                | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 37,856,000.00    | 2.66  |
| 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            | 1,065,268,681.61 | 74.96 |

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 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投资股票。

### 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  | 000625 | 长安汽车 | 8,300,000 | 124,002,000.00 | 8.73         |
| 2  | 000639 | 西王食品 | 3,500,000 | 84,945,000.00  | 5.98         |
| 3  | 002714 | 牧原股份 | 3,330,000 | 77,522,400.00  | 5.46         |
| 4  | 000902 | 新洋丰  | 6,700,000 | 75,442,000.00  | 5.31         |
| 5  | 600511 | 国药股份 | 2,325,300 | 69,991,530.00  | 4.93         |
| 6  | 000028 | 国药一致 | 1,040,000 | 69,576,000.00  | 4.90         |
| 7  | 600037 | 歌华有线 | 3,400,000 | 52,088,000.00  | 3.67         |
| 8  | 000513 | 丽珠集团 | 750,000   | 44,625,000.00  | 3.14         |
| 9  | 002022 | 科华生物 | 2,157,144 | 43,142,880.00  | 3.04         |
| 10 | 600820 | 隧道股份 | 3,900,000 | 42,939,000.00  | 3.02         |
| 11 | 002438 | 江苏神通 | 1,976,400 | 40,911,480.00  | 2.88         |
| 12 | 600337 | 美克家居 | 2,800,000 | 39,648,000.00  | 2.79         |
| 13 | 002159 | 三特索道 | 1,183,000 | 37,856,000.00  | 2.66         |
| 14 | 002366 | 台海核电 | 640,100   | 34,322,162.00  | 2.42         |
| 15 | 002538 | 司尔特  | 3,150,000 | 31,689,000.00  | 2.23         |
| 16 | 600885 | 宏发股份 | 930,000   | 29,713,500.00  | 2.09         |



|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 17 | 000599 | 青岛双星 | 3,100,000 | 24,614,000.00 | 1.73 |
| 18 | 300420 | 五洋科技 | 800,000   | 19,984,000.00 | 1.41 |
| 19 | 603308 | 应流股份 | 805,700   | 17,660,944.00 | 1.24 |
| 20 | 601600 | 中国铝业 | 3,500,000 | 14,770,000.00 | 1.04 |
| 21 | 600048 | 保利地产 | 1,400,000 | 12,782,000.00 | 0.90 |
| 22 | 300486 | 东杰智能 | 491,347   | 12,775,022.00 | 0.90 |
| 23 | 600889 | 南京化纤 | 966,053   | 12,703,596.95 | 0.89 |
| 24 | 300231 | 银信科技 | 600,000   | 11,106,000.00 | 0.78 |
| 25 | 000400 | 许继电气 | 550,000   | 9,982,500.00  | 0.70 |
| 26 | 300106 | 西部牧业 | 600,000   | 9,678,000.00  | 0.68 |
| 27 | 000807 | 云铝股份 | 1,000,000 | 6,700,000.00  | 0.47 |
| 28 | 600395 | 盘江股份 | 662,893   | 5,349,546.51  | 0.38 |
| 29 | 600123 | 兰花科创 | 655,517   | 5,270,356.68  | 0.37 |
| 30 | 300508 | 维宏股份 | 10,383    | 1,261,430.67  | 0.09 |
| 31 | 603823 | 百合花  | 36,764    | 1,203,653.36  | 0.08 |
| 32 | 600996 | 贵广网络 | 12,500    | 234,875.00    | 0.02 |
| 33 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641     | 88,403.48     | 0.01 |
| 34 | 603228 | 景旺电子 | 3,491     | 80,851.56     | 0.01 |
| 35 | 603577 | 汇金通  | 2,460     | 69,642.60     | 0.00 |
| 36 | 603877 | 太平鸟  | 3,180     | 67,734.00     | 0.00 |
| 37 | 300583 | 赛托生物 | 1,582     | 63,738.78     | 0.00 |
| 38 | 603416 | 信捷电气 | 1,076     | 53,886.08     | 0.00 |
| 39 | 002833 | 弘亚数控 | 2,743     | 48,331.66     | 0.00 |
| 40 | 603058 | 永吉股份 | 3,869     | 42,675.07     | 0.00 |
| 41 | 603886 | 元祖股份 | 2,241     | 39,665.70     | 0.00 |
| 42 | 603689 | 皖天然气 | 4,818     | 37,917.66     | 0.00 |
| 43 | 603239 | 浙江仙通 | 924       | 29,059.80     | 0.00 |
| 44 | 002835 | 同为股份 | 1,126     | 24,220.26     | 0.00 |
| 45 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316     | 24,179.04     | 0.00 |
| 46 | 603266 | 天龙股份 | 1,562     | 22,852.06     | 0.00 |
| 47 | 300587 | 天铁股份 | 1,438     | 20,290.18     | 0.00 |
| 48 | 002840 | 华统股份 | 1,814     | 11,881.70     | 0.00 |
| 49 | 002838 | 道恩股份 | 682       | 10,420.96     | 0.00 |
| 50 | 603186 | 华正新材 | 1,874     | 10,063.38     | 0.00 |
| 51 | 603032 | 德新交运 | 1,628     | 9,458.68      | 0.00 |
| 52 | 300586 | 美联新材 | 1,006     | 9,355.80      | 0.00 |
| 53 | 300591 | 万里马  | 2,397     | 7,358.79      | 0.00 |
| 54 | 300588 | 熙菱信息 | 1,380     | 6,817.20      | 0.00 |

#### 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<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 000625 | 长安汽车 | 83,496,648.92 | 4.27               |
| 2  | 000902 | 新洋丰  | 70,692,330.57 | 3.62               |
| 3  | 600037 | 歌华有线 | 69,633,016.79 | 3.56               |
| 4  | 600820 | 隧道股份 | 64,468,825.63 | 3.30               |
| 5  | 002470 | 金正大  | 50,947,444.30 | 2.61               |
| 6  | 002366 | 台海核电 | 50,022,094.57 | 2.56               |
| 7  | 600048 | 保利地产 | 46,578,000.00 | 2.38               |
| 8  | 002438 | 江苏神通 | 41,166,441.00 | 2.11               |
| 9  | 002714 | 牧原股份 | 37,176,606.74 | 1.90               |
| 10 | 600303 | 曙光股份 | 34,683,393.12 | 1.78               |
| 11 | 600123 | 兰花科创 | 33,636,019.15 | 1.72               |
| 12 | 000513 | 丽珠集团 | 33,610,404.44 | 1.72               |
| 13 | 600885 | 宏发股份 | 32,271,314.98 | 1.65               |
| 14 | 600337 | 美克家居 | 31,305,517.40 | 1.60               |
| 15 | 002239 | 奥特佳  | 29,246,386.33 | 1.50               |
| 16 | 002538 | 司尔特  | 27,534,179.88 | 1.41               |
| 17 | 000639 | 西王食品 | 26,873,181.60 | 1.38               |
| 18 | 000599 | 青岛双星 | 26,270,438.00 | 1.34               |
| 19 | 300231 | 银信科技 | 24,906,661.72 | 1.28               |
| 20 | 002159 | 三特索道 | 24,547,731.04 | 1.26               |

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<br>(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------------|
| 1  | 000625 | 长安汽车 | 118,215,175.26 | 6.05               |
| 2  | 600337 | 美克家居 | 91,038,745.86  | 4.66               |
| 3  | 600664 | 哈药股份 | 75,430,257.95  | 3.86               |
| 4  | 000063 | 中兴通讯 | 64,569,371.52  | 3.31               |
| 5  | 002538 | 司尔特  | 64,308,548.37  | 3.29               |
| 6  | 002714 | 牧原股份 | 57,383,064.58  | 2.94               |
| 7  | 000902 | 新洋丰  | 56,039,087.76  | 2.87               |
| 8  | 000920 | 南方汇通 | 52,986,522.65  | 2.71               |
| 9  | 000513 | 丽珠集团 | 50,876,768.23  | 2.60               |
| 10 | 002470 | 金正大  | 49,437,415.93  | 2.53               |
| 11 | 600197 | 伊力特  | 41,683,362.67  | 2.13               |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 12 | 600303 | 曙光股份 | 41,588,108.77 | 2.13 |
| 13 | 002340 | 格林美  | 37,471,025.53 | 1.92 |
| 14 | 300203 | 聚光科技 | 36,055,124.45 | 1.85 |
| 15 | 002239 | 奥特佳  | 34,867,338.25 | 1.78 |
| 16 | 000639 | 西王食品 | 32,884,922.76 | 1.68 |
| 17 | 600820 | 隧道股份 | 31,915,429.86 | 1.63 |
| 18 | 600889 | 南京化纤 | 31,427,975.64 | 1.61 |
| 19 | 600048 | 保利地产 | 31,145,000.00 | 1.59 |
| 20 | 600123 | 兰花科创 | 27,256,706.00 | 1.40 |

#### 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 | 1,375,456,180.25 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,603,443,467.07 |

注：不考虑相关交易费用

#### 8.5 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      | 169,423,156.40 | 11.92        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | 101,975,017.40 | 7.18         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 41,887,700.00  | 2.95         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 313,285,873.80 | 22.05        |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

**8.6 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  | 010213 | 02 国债(13) | 439,670 | 43,958,206.60 | 3.09         |
| 2  | 112138 | 12 苏宁 01  | 414,190 | 42,040,285.00 | 2.96         |
| 3  | 132001 | 14 宝钢 EB  | 370,000 | 41,887,700.00 | 2.95         |
| 4  | 019513 | 15 国债 13  | 400,180 | 39,937,964.00 | 2.81         |
| 5  | 010303 | 03 国债(3)  | 370,000 | 37,647,500.00 | 2.65         |

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

新洋丰（000902）的发行主体湖北新洋丰肥业股份有限公司于 2016 年 8 月 19 日发布公告称，其股东湖北洋丰集团股份有限公司及实际控制人收到中国证券监督管理委员会关于超比例持股未披露违法行为、短线交易行为、以及操纵证券市场行为予以责令改正、警告、没收违法所得、并处罚款的《行政处罚决定书》（【2016】100 号）。

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

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   | 294,419.50   |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,461,090.08 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,144,892.69 |
| 5  | 应收申购款   | 29,060.17    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 4,929,462.44 |

### 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

本基金本报告期末前十名股票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<br>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<br>比例 | 持有份额             | 占总份额<br>比例 |
| 23,670   | 57,520.58     | 324,394,519.33 | 23.83%     | 1,037,117,533.67 | 76.17%     |

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|----------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有<br>本基金 | 1,504,844.72 | 0.11%    |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 50~100            |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2004年4月12日)基金份额总额 | 8,324,975,786.82 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,151,380,967.87 |
| 本报告期基金总申购份额               | 1,376,763,468.69 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 1,166,632,383.56 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 1,361,512,053.00 |

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内

发生的转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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. 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。本基金报告年度支付给毕马威华振会计师事务所有限公司的报酬为 10 万元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续 13 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 |    |
| 浙商证券股份有限公司   | 1      | 158,994,812.57 | 5.35%        | 144,892.68 | 5.30%      | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中国国际金融       | 1      | 287,115,348.31 | 9.65%        | 261,648.24 | 9.58%      | -  |

|              |   |                |        |            |        |   |
|--------------|---|----------------|--------|------------|--------|---|
| 股份有限公司       |   |                |        |            |        |   |
| 海通证券股份有限公司   | 2 | 600,461,587.62 | 20.19% | 550,186.31 | 20.14% | - |
| 平安证券股份有限公司   | 1 | 179,957,152.09 | 6.05%  | 167,593.39 | 6.14%  | - |
| 招商证券股份有限公司   | 1 | 894,303,155.45 | 30.07% | 814,980.68 | 29.84% | - |
| 国元证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 光大证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 华泰证券股份有限公司   | 1 | 364,137,960.98 | 12.24% | 339,123.68 | 12.42% | - |
| 国信证券股份有限公司   | 1 | 70,454,709.96  | 2.37%  | 65,614.90  | 2.40%  | - |
| 申万宏源证券有限公司   | 1 | 24,657,224.50  | 0.83%  | 22,470.09  | 0.82%  | - |
| 兴业证券股份有限公司   | 1 | 229,031,737.70 | 7.70%  | 213,295.57 | 7.81%  | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | 51,899,977.49  | 1.75%  | 47,296.53  | 1.73%  | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | 1 | 81,422,886.62  | 2.74%  | 75,828.43  | 2.78%  | - |
| 中信证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 国联证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |
| 中泰证券股份有限公司   | 1 | 31,375,943.90  | 1.06%  | 28,593.00  | 1.05%  | - |
| 东方证券股份有限公司   | 1 | -              | -      | -          | -      | - |

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

本报告期内,停止租用安信证券股份有限公司交易单元一个。平安证券有限责任公司更名为平安证券股份有限公司。

**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 |
| 浙商证券股份有限公司 | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

|              |                |        |                |        |   |   |
|--------------|----------------|--------|----------------|--------|---|---|
| 国泰君安证券股份有限公司 | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | 8,572,919.33   | 1.39%  | -              | -      | - | - |
| 海通证券股份有限公司   | 49,257,870.05  | 7.99%  | 20,000,000.00  | 1.18%  | - | - |
| 平安证券股份有限公司   | 24,085,085.20  | 3.91%  | 310,000,000.00 | 18.29% | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 国元证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 光大证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 华泰证券股份有限公司   | 240,545,862.57 | 39.01% | 175,000,000.00 | 10.32% | - | - |
| 国信证券股份有限公司   | 31,273,290.32  | 5.07%  | 180,000,000.00 | 10.62% | - | - |
| 申万宏源证券有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 兴业证券股份有限公司   | 200,541,868.86 | 32.52% | 300,000,000.00 | 17.70% | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 中国中投证券有限责任公司 | 62,308,618.52  | 10.11% | 710,000,000.00 | 41.89% | - | - |
| 中信证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 国联证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 中泰证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |
| 东方证券股份有限公司   | -              | -      | -              | -      | - | - |

### 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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>证券时报、公司网站          | 2016-01-16 |
| 10 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金四季报  | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、证券日报、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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、<br>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所持慈文传媒等股票估值调整的公告                             | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、公司网站          | 2016-02-27 |
| 21 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-02-29 |
| 22 | 国联安基金管理有限公司关于旗下基金所持   | 中国证券报、上证报、                       | 2016-03-02 |

|    |   |                          |            |
|----|---|--------------------------|------------|
|    | 股票估值调整的公告   | 证券时报、公司网站                |            |
| 23 | 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 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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 |
| 26 | 国联安基金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 | 2016-03-15 |
| 27 | 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 |
| 28 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金 2015 年度报告摘要                                 | 中国证券报、上证报、证券时报、公司网站      | 2016-03-28 |
| 29 | 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 |
| 30 | 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 |
| 31 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海浦东发展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、公司网站      | 2016-04-08 |
| 32 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海浦东发展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、公司网站      | 2016-04-11 |
| 33 | 国联安基金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（展恒基金）                    | 中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站 | 2016-04-13 |
| 34 | 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 |
| 35 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金 2016 年第一季度报告                                | 中国证券报、上证报、证券时报、公司网站      | 2016-04-22 |
| 36 | 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 |
| 37 | 国联安基金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 | 2016-04-29 |
| 38 | 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 |
| 39 | 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、     | 2016-05-09 |

|    |  | 公司网站                                 |            |
|----|--|--------------------------------------|------------|
| 40 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-05-11 |
| 41 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-05-13 |
| 42 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安德盛小盘精选证券投资基金参加招商证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告            | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、公司网站              | 2016-05-18 |
| 43 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-05-20 |
| 44 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金招募说明书更新摘要   | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、公司网站              | 2016-05-26 |
| 45 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站     | 2016-06-03 |
| 46 | 国联安基金管理有限公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通定投、转换及参加费率优惠的公告        | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站     | 2016-06-03 |
| 47 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-06-04 |
| 48 | 国联安基金管理有限公司关于旗下国联安德盛小盘精选证券投资基金参与平安银行股份有限公司定期定额投资业务费率优惠活动的公告      | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、公司网站              | 2016-06-15 |
| 49 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-06-15 |
| 50 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-06-24 |
| 51 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-06-25 |
| 52 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站     | 2016-06-30 |
| 53 | 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、<br>证券时报、公司网站              | 2016-07-06 |
| 54 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站、深交所 | 2016-07-18 |
| 55 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金 2016 年第二季度报告                                     | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、公司网站              | 2016-07-20 |
| 56 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站     | 2016-07-22 |

|    |   |                                  |            |
|----|---|----------------------------------|------------|
| 57 | 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、<br>证券时报、公司网站          | 2016-07-25 |
| 58 | 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、<br>证券时报、公司网站          | 2016-07-29 |
| 59 | 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、<br>证券时报、公司网站          | 2016-07-30 |
| 60 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-08-09 |
| 61 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-08-12 |
| 62 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-08-15 |
| 63 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-08-19 |
| 64 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-08-19 |
| 65 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金 2016 年半年度报告摘要   | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-08-26 |
| 66 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金分红公告   | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、公司网站          | 2016-08-29 |
| 67 | 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、<br>证券时报、公司网站          | 2016-09-03 |
| 68 | 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、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-09-20 |
| 69 | 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、<br>证券时报、公司网站          | 2016-10-24 |
| 70 | 国联安德盛小盘精选证券投资基金三季度报   | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、证券日报、<br>公司网站 | 2016-10-24 |
| 71 | 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                                    | 中国证券报、上证报、<br>证券时报、证券日报、         | 2016-11-17 |

|    |   |                              |            |
|----|---|------------------------------|------------|
|    | 销机构并开通申购、赎回、定投、转换及参加费率优惠的公告                                       | 公司网站                         |            |
| 72 | 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 |
| 73 | 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 |
| 74 | 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 |
| 75 | 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 |
| 76 | 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 |
| 77 | 国联安基金管理有限公司关于增加上海凯石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 | 中国证券报、上证报、证券时报、证券日报、深交所、公司网站 | 2016-12-28 |
| 78 | 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德盛小盘精选证券投资基金发行及募集的文件
- 2、国联安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照及公司章程
- 3、《国联安德盛小盘精选证券投资基金基金合同》
- 4、《国联安德盛小盘精选证券投资基金托管协议》
- 5、国联安德盛小盘精选证券投资基金审计报告正本、财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 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