

**上投摩根双核平衡混合型证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月三十日

## §1 重要提示

### 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 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金简称       | 上投摩根双核平衡混合       |
| 基金主代码      | 373020           |
| 交易代码       | 373020           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2008 年 5 月 21 日  |
| 基金管理人      | 上投摩根基金管理有限公司     |
| 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 | 155,208,510.47 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

## 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金深化价值投资理念，精选具备较高估值优势的上市公司股票与优质债券等，持续优化投资风险与收益的动态匹配，通过积极主动的组合管理，追求基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略 | <p>1、股票投资策略</p> <p>价值投资注重股票内在价值的发现。在内在价值确定以后，通过股票市场价格和内在价值的比较，就可以明确投资方向。特别当股票的价格低于它的内在价值时，就存在一个正的安全边际。足够的安全边际使投资拥有更容易取胜的优势，因为在价值引力作用下，股票价格更倾向于上涨。所以，安全边际越高，投资风险就会相对较低。本基金将运用安全边际策略有效挖掘价值低估的股票类投资品种。在控制宏观经济趋势、产业发展周期等宏观经济环境变量基础上，考察上市公司的商业模式、管理能力、财务状况等影响企业持续经营的因素，然后综合运用量化价值模型来衡量股票价格是高估还是低估。根据不同的产业和行业特征，本基金将有针对性地选用不同的 P/E、P/CFPS、P/S、P/B 等乘数法和 DCF 增长模型建立股票选择池。</p> <p>(1) 宏观经济分析本基金基于对宏观经济运行状况及政策分析、财政政</p> |

策与货币政策运行状况分析、行业运行景气状况分析的基础上，重点判断宏观经济周期对市场不同行业的影响，作为资产配置的依据。同时根据宏观经济对市场影响的分析，初步判断市场的多空方向，决定大类资产配置。

(2) 行业分析本基金将根据各行业所处生命周期、产业竞争结构、近期发展趋势等方面因素对各行业的相对盈利能力及投资吸引力进行评价，考察净资产收益率、营运周期、销售收入、净利润等指标，对各行业投资机会进行评估，并根据行业综合评价结果确定股票资产中各行业的权重。

(3) 公司质地分析企业在行业中的相对竞争力是决定企业成败和投资价值的关键，本基金将根据公司质地对上市公司当前和未来的竞争优势加以评估。公司质地良好的企业通常具备以下特征：企业在管理、品牌、资源、技术、创新能力中的某一方面或多个方面具有竞争对手在短时间内难以模仿的显著优势，从而能够获得超越行业平均的盈利水平和增长速度。本基金将通过包括实际调研在内的多种分析手段，对上市公司质地进行判断。(4) 股票估值水平分析本基金的战略目标是构造可以创造主动管理报酬的投资组合，上市公司经过竞争优势指标筛选之后，将由研究团队进行估值水平考察。通过基本面和估值指标筛选的基础组合即被纳入上投摩根基金公司策略性评价体系。本基金在对股票进行估值时，首先采用现金流折现模型（DCF）计算出股票的内在价值，然后在第二阶段采用乘数估值法（Multiple），通过对对同行业公司的情况对样本公司价值进行比较修正，使得对于股票价值的评估更加准确可靠。

## 2、固定收益类投资策略

本基金的债券投资策略是建立在对债券核心内在价值的认识上。我们将采用更为有效的债券估值模型，同时综合考虑宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势，采取至上而下和至下而上结合的投资策略积极配置资产。在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，通过组合投资为投资者创造长期回报。具体而言，我们将运用利率预期策略、骑乘收益曲线策略和类属资产配置策略等积极策略配置各类债券资产。

(1) 利率预期策略：本基金将首先根据对国内外经济形势的预测，分析

市场投资环境的变化趋势，重点关注利率趋势变化。通过全面分析宏观经济、货币政策与财政政策、物价水平变化趋势等因素，对利率走势形成合理预期。

(2) 骑乘收益率曲线策略：骑乘收益率曲线策略是短期货币市场证券管理中流行的一种策略。具体操作时买入收益率曲线最突起部位所在剩余期限的债券，这一期限的收益率水平此时处于相对较高的位置，随着一段时间的持有，当收益率下降时，对应的将是债券价格的走高，而这一期限债券的涨幅将会高于其他期限，这样就可以获得更好的价差收益。

(3) 类属资产配置：在类属资产配置层次，本基金根据市场和类属资产的风险收益特征，在判断各类属的利率期限结构与交易活跃的国家信用等级短期利率期限结构应具有合理利差水平基础上，将市场细分为交易所国债、交易所企业债、银行间国债、银行间金融债等子市场。结合各类属资产的市场容量、信用等级和流动性特点，在此基础上运用修正的均值-方差等模型，定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整，确定类属资产的最优权重。

### 3、权证投资策略

本基金将在法律法规及基金合同规定的范围内，采取积极的态度进行权证投资。权证投资的主要目的在于对冲组合中证券的持有风险，及在正确估值标的证券的基础上获取权证投资收益。本基金将采用业界广泛应用的 Black-Scholes Pricing Model(BSPM)对权证进行估价。对于股票基本面和投资价值的判断一贯是本公司投资的重要依据。在投资权证前，基金管理人员和研究员应对标的股票的基本面和内在价值作出分析判断。

### 4、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券时，将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和对个案的具体分析，确定资产合理配置比例，在保证资产安全性的前提条件下，以期获得长期稳定收益。

### 5、资产配置策略

资产配置是本基金资产管理的重要环节。本基金是一只注重价值投资的平衡型基金，资产配置策略依据对宏观经济、股市政策、市场趋势等因

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>素的判断，对股票市场和债券市场的风险收益特征进行科学的评估后，在本基金投资范围内，将基金资产主要分配在权益类、固定收益类之间，并根据投资环境的实际变化情况，在各类金融资产之间进行实时动态配置，以期承受尽量小的投资风险，并取得尽可能大的主动管理回报。具体而言，在正常的市场环境下，本基金将保持不同类型资产配置比例的相对稳定。如果出现股票市场整体估值水平较大程度偏离企业基本面的情况，会对权益类和固定收益类资产的配置比例做出相应的调整，以减少投资风险。在股票市场安全边际降低，且综合考虑收益风险后投资吸引力低于固定收益资产时，本基金将降低权益类资产的配置比例；相反，在股票市场安全边际增厚时，本基金将相应增加权益类资产的配置比例。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%   |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，在证券投资基金中属于中高风险品种，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券基金与货币市场基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人             | 基金托管人               |
|-------------|------|-------------------|---------------------|
| 名称          |      | 上投摩根基金管理有限公司      | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 胡迪                | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38794888      | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | services@cifm.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-889-4888      | 95588               |
| 传真          |      | 021-20628400      | 010-66105798        |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cifm.com">http://www.cifm.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所                                      |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016 年         | 2015 年         | 2014 年         |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | -2,624,588.64  | 144,951,887.70 | 50,270,290.38  |
| 本期利润          | -28,599,184.85 | 143,053,682.05 | 46,740,093.57  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1808        | 0.7546         | 0.1685         |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.32%         | 50.30%         | 15.62%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末        | 2015 年末        | 2014 年末        |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.6413         | 1.0189         | 0.4191         |
| 期末基金资产净值      | 254,741,163.08 | 319,660,075.64 | 341,766,661.88 |
| 期末基金份额净值      | 1.6413         | 2.0443         | 1.4431         |

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。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。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

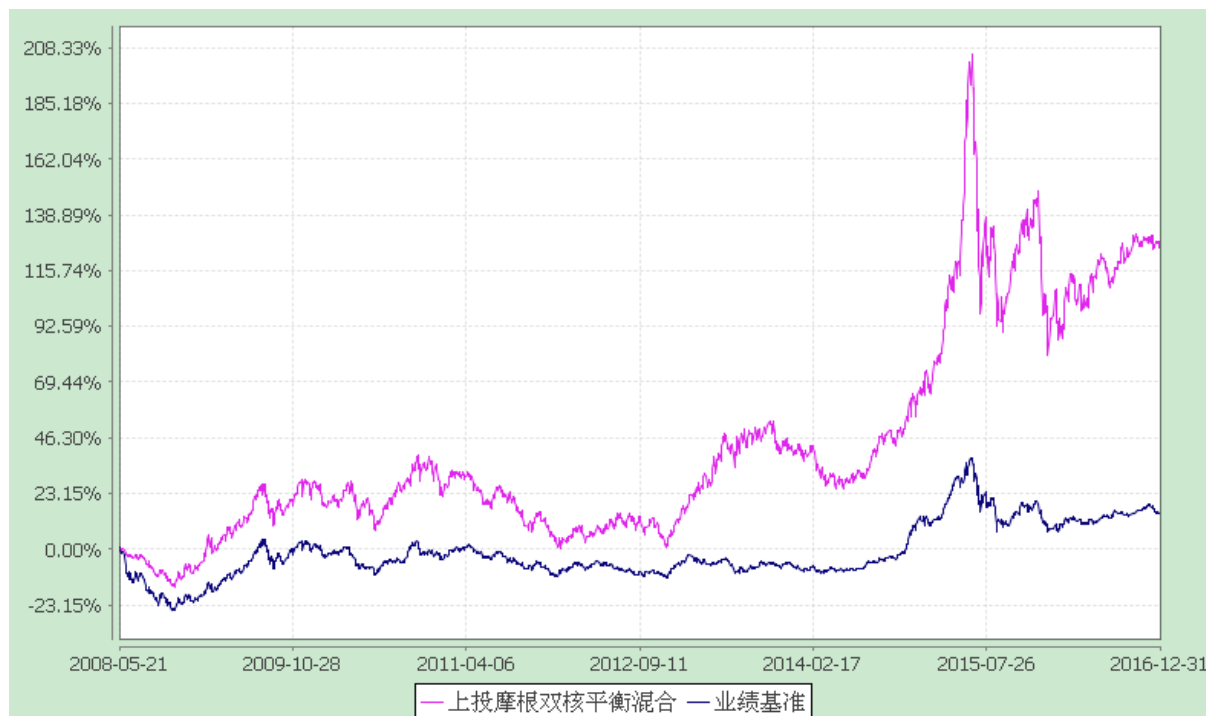
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 1.35%    | 0.60%       | 0.89%      | 0.36%         | 0.46%   | 0.24% |
| 过去六个月      | 3.30%    | 0.66%       | 3.15%      | 0.38%         | 0.15%   | 0.28% |
| 过去一年       | -8.32%   | 1.44%       | -3.95%     | 0.70%         | -4.37%  | 0.74% |
| 过去三年       | 59.32%   | 1.56%       | 28.30%     | 0.89%         | 31.02%  | 0.67% |
| 过去五年       | 115.01%  | 1.39%       | 31.36%     | 0.81%         | 83.65%  | 0.58% |
| 自基金合同生效起至今 | 125.58%  | 1.26%       | 15.10%     | 0.89%         | 110.48% | 0.37% |

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

### 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

上投摩根双核平衡混合型证券投资基金

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  
(2008 年 5 月 21 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：本基金合同生效日为 2008 年 5 月 21 日，图示时间段为 2008 年 5 月 21 日至 2016 年 12 月 31 日。

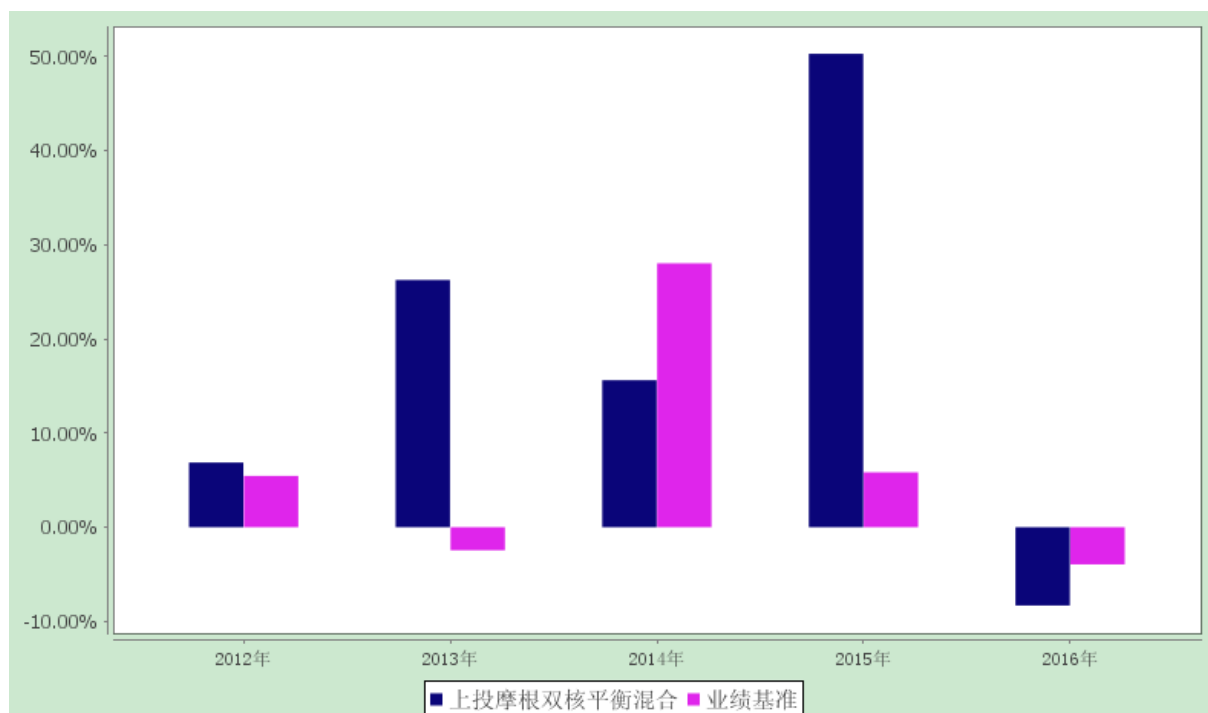
本基金建仓期自 2008 年 5 月 21 日至 2008 年 11 月 20 日。建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

### 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

上投摩根双核平衡混合型证券投资基金

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：本基金于 2008 年 5 月 21 日正式成立，图示的时间段为 2012 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度    | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额     | 年度利润分配合计      | 备注 |
|-------|-------------|---------------|---------------|---------------|----|
| 2016年 | 2.038       | 14,121,722.57 | 16,174,271.92 | 30,295,994.49 | -  |
| 2015年 | 0.839       | 7,807,770.24  | 11,653,869.38 | 19,461,639.62 | -  |
| 2014年 | 0.560       | 8,097,075.47  | 9,471,718.53  | 17,568,794.00 | -  |
| 合计    | 3.437       | 30,026,568.28 | 37,299,859.83 | 67,326,428.11 | -  |

## §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

上投摩根基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准，于 2004 年 5 月 12 日正式成立。公司由上海国际信托投资有限公司（2007 年 10 月 8 日更名为“上海国际信托有限公司”）与摩根资产管理（英国）有限公司合资设立，注册资本为 2.5 亿元人民币，注册地上海。截至 2016 年 12 月底，公司管理的基金共有五十二只，均为开放式基金，分别是：上投摩根中国优势证券投资

基金、上投摩根货币市场基金、上投摩根阿尔法混合型证券投资基金、上投摩根双息平衡混合型证券投资基金、上投摩根成长先锋混合型证券投资基金、上投摩根内需动力混合型证券投资基金、上投摩根亚太优势混合型证券投资基金、上投摩根双核平衡混合型证券投资基金、上投摩根中小盘混合型证券投资基金、上投摩根纯债债券型证券投资基金、上投摩根行业轮动混合型证券投资基金、上投摩根大盘蓝筹股票型证券投资基金、上投摩根全球新兴市场混合型证券投资基金、上投摩根新兴动力混合型证券投资基金、上投摩根强化回报债券型证券投资基金、上投摩根健康品质生活混合型证券投资基金、上投摩根全球天然资源混合型证券投资基金、上投摩根分红添利债券型证券投资基金、上投摩根中证消费服务领先指数证券投资基金、上投摩根核心优选混合型证券投资基金、上投摩根轮动添利债券型证券投资基金、上投摩根智选 30 混合型证券投资基金、上投摩根成长动力混合型证券投资基金、上投摩根天颐年丰混合型证券投资基金、上投摩根岁岁盈定期开放债券型证券投资基金、上投摩根红利回报混合型证券投资基金、上投摩根转型动力灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、上投摩根核心成长股票型证券投资基金、上投摩根民生需求股票型证券投资基金、上投摩根优信增利债券型证券投资基金、上投摩根现金管理货币市场基金、上投摩根纯债丰利债券型证券投资基金、上投摩根天添盈货币市场基金、上投摩根天添宝货币市场基金、上投摩根纯债添利债券型证券投资基金、上投摩根稳进回报混合型证券投资基金、上投摩根安全战略股票型证券投资基金、上投摩根卓越制造股票型证券投资基金、上投摩根整合驱动灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根动态多因子策略灵活配置证券投资基金、上投摩根智慧互联股票型证券投资基金、上投摩根科技前沿灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根新兴服务股票型证券投资基金、上投摩根医疗健康股票型证券投资基金、上投摩根文体休闲灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根策略精选灵活配置混合型证券投资基金、上投摩根安鑫回报混合型证券投资基金、上投摩根岁岁丰定期开放债券型证券投资基金、上投摩根中国世纪灵活配置混合型证券投资基金和上投摩根全球多元配置证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|-----|---------|----------------------|------|------------|---|
|     |         | 任职日期                 | 离任日期 |            |   |
| 陈思郁 | 本基金基金经理 | 2015-08-04           | -    | 9 年        | 陈思郁女士自 2008 年 5 月至 2009 年 8 月在国泰君安研究所担任研究员，自 2009 年 9 月起加入上投摩根基金管理有限公司， |

|    |           |           |   |     |  |
|----|-----------|-----------|---|-----|--|
|    |           |           |   |     | 历任行业专家、基金经理助理，现任国内权益投资一部基金经理，自 2015 年 8 月起担任上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金经理，自 2016 年 10 月起同时担任上投摩根安全战略股票型证券投资基金基金经理。                               |
| 郭毅 | 本基金基金经理助理 | 2016-3-22 | - | 6 年 | 上海财经大学企业管理硕士，2008 年 7 月至 2010 年 2 月在德勤会计事务所担任审计员，2010 年 3 月至 2014 年 9 月先后在上海钢联电子商务有限公司和兴业证券股份有限公司担任行业研究员，2014 年 10 月加入上投摩根基金管理有限公司，任研究员。 |

注：1.任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金合同》的规定。基金经理对个股和投资组合的比例遵循了投资决策委员会的授权限制，基金投资比例符合基金合同和法律法规的要求。

#### 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

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规的要求，制订了《上投摩根基金管理有限公司公平交易制度》，规范了公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

公司执行自上而下的三级授权体系，依次为投资决策委员会、投资总监、经理人，经理人在其授权范围内自主决策，投资决策委员会和投资总监均不得干预其授权范围内的投资活动。公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。对于交易所市场投资活动，不同投资组合在买卖同一证券时，按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，

通过交易对手库控制和交易室询价机制，严格防范交易对手风险并抽检价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。

公司制订了《异常交易监控与报告制度》，通过系统和人工相结合的方式对投资交易行为的监控分析，并执行异常交易行为监控分析记录工作机制，确保公平交易可稽核。公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行上述公平交易制度和控制方法，开展公平交易工作。通过对不同投资组合之间的收益率差异、以及不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易时机和交易价差等方面的监控分析，公司未发现整体公平交易执行出现异常的情况。

其中，在同向交易的监控和分析方面，根据法规要求，公司对不同投资组合的同日和临近交易日的同向交易行为进行监控，通过定期抽查前述的同向交易行为，定性分析交易时机、对比不同投资组合长期的交易趋势，重点关注任何可能导致不公平交易的情形。对于识别的异常情况，由相关投资组合经理对异常交易情况进行合理解释。同时，公司根据法规的要求，通过系统模块定期对连续四个季度内不同投资组合在不同时间窗内（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行分析，采用概率统计方法，主要关注不同投资组合之间同向交易价差均值为零的显著性检验，以及同向交易价格占优的交易次数占比分析。

报告期内，通过前述分析方法，未发现不同投资组合之间同向交易价差异异常的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，通过对交易价格、交易时间、交易方向等的抽样分析，公司未发现存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形：报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为三次，均发生在纯量化投资组合与主动管理投资组合之间。

#### 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

在经历了 2015 年下半年的大幅下跌，以及 2016 年初的熔断后，市场随后展开了一波较长的温和上涨，同时流动性依然宽松，以及 2016 年四季度以来宏观经济的复苏态势也是超出很多人的预期。在这样的背景下，尽管本基金于 2016 年一季度遭受了一定损失，但后续积极寻找经济复苏逻辑，把握了新能源汽车以及 PPP 等行业的投资机会，在一定程度上补回了部分一季度的损失。本基金债券部分前三季度保持了中性的债券仓位，四季度面对市场调整，压缩了债券整体仓位和久期水平，维持组合仓位和久期整体均衡。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金份额净值增长率为-8.32%，同期业绩比较基准收益率为-3.95%。

#### 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，虽然对于流动性，我们不能预期像之前那么宽松，但明显的利率抬升，在目前的经济环境下，也是很难发生的；对于宏观经济，我们并不认为会继续超预期复苏，但经济复苏的持续性，可能会超出很多人的预测，一方面对于基建，政府依然有很多政策调控空间，市场一直担心的地产投资放缓，由于基数较低，对于经济负面拖累不会那么大，更重要的是我们看到了消费的兴起，汽车、白酒、家电等消费数据好转，说明中国中产阶级消费实力不容小觑，将在较长时间内对于中国经济起到持续的支撑作用。我们认为 A 股的结构性的机会依然不少。

在这样的背景下，本基金继续坚持投资景气度较高的行业，从中选取优质龙头公司，或是存在预期差的标的，综合参考估值、市值等指标，争取为投资者创造良好回报。同时跟踪经济企稳的力度和持续性，挖掘可能存在中游盈利复苏标的，消费持续升级受益品种，以及涨价预期强烈的标的的投资机会。展望 2017 年，债市波动可能增加，但收益率整体不具备持续高位的基础。本基金将密切跟踪市场流动性变化情况，关注高资质信用债的配置时间窗口和利率债波段交易机会，保持组合久期和仓位维持在合理水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司的基金估值和会计核算由基金会计部负责，根据相关的法律法规规定、基金合同的约定，制定了内部控制措施，对基金估值和会计核算的各个环节和整个流程进行风险控制，目的是保证基金估值和会计核算的准确性。基金会计部人员均具备基金从业资格和相关工作经历。本公司成立了估值委员会，并制订有关议事规则。估值委员会成员包括公司管理层、督察长、基金会计、风险管

理等方面的负责人以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会对估值事项发表意见，评估基金估值的公允性和合理性。基金经理是估值委员会的重要成员，参加估值委员会会议，参与估值程序和估值技术的讨论。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金实际运作情况，本基金以 2015 年 12 月 31 日为收益分配基准日，于 2016 年 01 月 14 日实施收益分配，每 10 份基金份额派发红利 2.038 元，合计发放红利 30,295,994.49 元，符合法律法规的规定及《基金合同》的约定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本基金托管人在对上投摩根双核平衡混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，上投摩根双核平衡混合型证券投资基金的管理人——上投摩根基金管理有限公司在上投摩根双核平衡混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 30,295,994.49 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

本托管人依法对上投摩根基金管理有限公司编制和披露的上投摩根双核平衡混合型证券投资基金 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

上投摩根双核平衡混合型证券投资基金 2016 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计、注册会计师陈玲、曹阳签字出具了“无保留意见的审计报告”（编号：普华永道中天审字(2017)第 20528 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：上投摩根双核平衡混合型证券投资基金

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 | 13,130,580.97           | 10,087,348.47            |
| 结算备付金    |         | 561,372.72              | 1,981,030.79             |
| 存出保证金    |         | 86,302.16               | 224,456.99               |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 230,886,790.09          | 306,818,816.85           |
| 其中：股票投资  |         | 157,740,219.29          | 218,214,185.35           |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 73,146,570.80           | 88,604,631.50            |
| 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 | 15,000,000.00           | -                        |
| 应收证券清算款  |         | -                       | 145,701.77               |
| 应收利息     | 7.4.7.5 | 1,772,621.11            | 2,726,889.38             |
| 应收股利     |         | -                       | -                        |
| 应收申购款    |         | 16,373.48               | 66,475.02                |

|                   |            |                                 |                                  |
|-------------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 递延所得税资产           |            | -                               | -                                |
| 其他资产              | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>       |            | <b>261,454,040.53</b>           | <b>322,050,719.27</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           |            | 4,995,000.00                    | -                                |
| 应付赎回款             |            | 10,269.98                       | 286,054.98                       |
| 应付管理人报酬           |            | 325,322.94                      | 396,796.49                       |
| 应付托管费             |            | 54,220.51                       | 66,132.77                        |
| 应付销售服务费           |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用            | 7.4.7.7    | 346,931.80                      | 609,931.42                       |
| 应交税费              |            | 671,103.28                      | 671,103.28                       |
| 应付利息              |            | -                               | -                                |
| 应付利润              |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债           |            | -                               | -                                |
| 其他负债              | 7.4.7.8    | 310,028.94                      | 360,624.69                       |
| <b>负债合计</b>       |            | <b>6,712,877.45</b>             | <b>2,390,643.63</b>              |
| <b>所有者权益：</b>     |            | -                               | -                                |
| 实收基金              | 7.4.7.9    | 155,208,510.47                  | 156,363,843.94                   |
| 未分配利润             | 7.4.7.10   | 99,532,652.61                   | 163,296,231.70                   |
| <b>所有者权益合计</b>    |            | <b>254,741,163.08</b>           | <b>319,660,075.64</b>            |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |            | <b>261,454,040.53</b>           | <b>322,050,719.27</b>            |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6413 元，基金份额总额 155,208,510.47 份。



## 7.2 利润表

会计主体：上投摩根双核平衡混合型证券投资基金

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>-20,995,763.97</b>               | <b>154,342,372.35</b>               |
| 1.利息收入                |          | 4,290,916.11                        | 6,669,324.13                        |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 159,841.33                          | 197,297.28                          |
| 债券利息收入                |          | 4,066,612.94                        | 6,440,331.84                        |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入            |          | 64,461.84                           | 31,695.01                           |
| 其他利息收入                |          | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 655,091.75                          | 149,414,113.45                      |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | 204,715.92                          | 148,216,780.58                      |
| 基金投资收益                |          | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | -20,295.34                          | 336,132.80                          |
| 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 | 470,671.17                          | 861,200.07                          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -25,974,596.21                      | -1,898,205.65                       |
| 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 | 32,824.38                           | 157,140.42                          |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>7,603,420.88</b>                 | <b>11,288,690.30</b>                |
| 1. 管理人报酬              |          | 3,710,474.69                        | 5,085,490.35                        |
| 2. 托管费                |          | 618,412.52                          | 847,581.76                          |

|                            |          |                       |                       |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 3. 销售服务费                   |          | -                     | -                     |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18 | 2,860,732.88          | 4,568,608.29          |
| 5. 利息支出                    |          | 63,537.76             | 383,155.65            |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 63,537.76             | 383,155.65            |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19 | 350,263.03            | 403,854.25            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-28,599,184.85</b> | <b>143,053,682.05</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-28,599,184.85</b> | <b>143,053,682.05</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上投摩根双核平衡混合型证券投资基金

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                               |                |                |
|-----------------------------------|----------------------------------|----------------|----------------|
|                                   | 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）                   | 156,363,843.94                   | 163,296,231.70 | 319,660,075.64 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                | -28,599,184.85 | -28,599,184.85 |
| 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） | -1,155,333.47                    | -4,868,399.75  | -6,023,733.22  |
| 其中：1.基金申购款                        | 30,283,328.18                    | 16,295,559.75  | 46,578,887.93  |
| 2.基金赎回款                           | -31,438,661.65                   | -21,163,959.50 | -52,602,621.15 |
| 四、本期向基金份额持                        | -                                | -30,295,994.49 | -30,295,994.49 |

|  |                                  |                 |                 |
|--|----------------------------------|-----------------|-----------------|
| 有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）           |                                  |                 |                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 155,208,510.47                   | 99,532,652.61   | 254,741,163.08  |
| 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）                        | 236,825,423.63                   | 104,941,238.25  | 341,766,661.88  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 143,053,682.05  | 143,053,682.05  |
| 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）      | -80,461,579.69                   | -65,237,048.98  | -145,698,628.67 |
| 其中：1.基金申购款                             | 82,364,755.46                    | 72,180,363.59   | 154,545,119.05  |
| 2.基金赎回款                                | -162,826,335.15                  | -137,417,412.57 | -300,243,747.72 |
| 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） | -                                | -19,461,639.62  | -19,461,639.62  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 156,363,843.94                   | 163,296,231.70  | 319,660,075.64  |

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：章硕麟，主管会计工作负责人：胡志强，会计机构负责人：张璐

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

上投摩根双核平衡混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]第 502 号《关于核准上投摩根双核平衡混合型证券投资基金募集的批复》核准,由上投摩根基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,423,050,546.77 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 062 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 5 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,423,318,139.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 267,592.43 份基金份额。本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 40%-70%,债券及其它短期金融工具为 25%-55%,并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金投资重点是具备较高估值优势的上市公司股票等,80%以上的股票基金资产属于上述投资方向所确定的内容。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 X50%+上证国债指数收益率 X50%。

本财务报表由本基金的基金管理人上投摩根基金管理有限公司于 2017 年 3 月 29 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上投摩根双核平衡混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                                     | 与本基金的关系                        |
|---|--------------------------------|
| 上投摩根基金管理有限公司                              | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构            |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)                    | 基金托管人、基金销售机构                   |
| 上海国际信托有限公司(“上海信托”)                        | 基金管理人的股东                       |
| 摩根资产管理(英国)有限公司                            | 基金管理人的股东                       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司                            | 基金管理人的股东上海国际信托有限公司的控股股东、基金销售机构 |
| 尚腾资本管理有限公司                                | 基金管理人的子公司                      |
| 上投摩根资产管理(香港)有限公司                          | 基金管理人的子公司                      |
| 上信资产管理有限公司                                | 基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司        |
| 上海国利货币经纪有限公司                              | 基金管理人的股东上海国际信托有限公司控制的公司        |
| J.P. Morgan Investment Management Limited | 基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司    |
| J.P. Morgan 8CS Investments (GP) Limited  | 基金管理人的股东摩根资产管理(英国)有限公司控制的公司    |

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据浦发银行于 2016 年 3 月 16 日发布的《上海浦东发展银行股份有限公司关于发行股份购买资产暨关联交易之标的资产过户完成的公告》，浦发银行发行股份购买资产暨关联交易事项已经中国证监会证监许可[2015]2677 号《关于核准上海浦东发展银行股份有限公司向上海国际集团有

限公司等发行股份购买资产的批复》核准。于 2016 年 3 月 15 日，上海信托已完成了相关工商变更登记手续，成为浦发银行的控股子公司。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

###### 7.4.8.2.1 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<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年<br>12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,710,474.69                    | 5,085,490.35                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 717,238.20                      | 916,756.15                           |

注：支付基金管理人上投摩根基金管理有限公司的管理人报酬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。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

###### 7.4.8.2.2 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<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 618,412.52                      | 847,581.76                           |

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

###### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

## 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

无。

## 7.4.8.5 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<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 |            |
|--------|-----------------------------|------------|----------------------------------|------------|
|        | 期末余额                        | 当期利息收入     | 期末余额                             | 当期利息收入     |
| 中国工商银行 | 13,130,580.97               | 141,582.31 | 10,087,348.47                    | 169,291.89 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

## 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

## 7.4.9.1 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

| 7.4.9.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |              |            |            |    |
|---------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码                | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 601375              | 中原证券 | 2016/12/20 | 2017/01/03 | 新股未上市  | 4.00  | 4.00   | 26,695       | 106,780.00 | 106,780.00 | -  |
| 603877              | 太平鸟  | 2016/12/29 | 2017/01/09 | 新股未上市  | 21.30 | 21.30  | 3,180        | 67,734.00  | 67,734.00  | -  |
| 300583              | 赛托生物 | 2016/12/29 | 2017/01/06 | 新股未上市  | 40.29 | 40.29  | 1,582        | 63,738.78  | 63,738.78  | -  |
| 603035              | 常熟汽饰 | 2016/12/27 | 2017/01/05 | 新股未上市  | 10.44 | 10.44  | 2,316        | 24,179.04  | 24,179.04  | -  |
| 300587              | 天铁股份 | 2016/12/28 | 2017/01/05 | 新股未上市  | 14.11 | 14.11  | 1,438        | 20,290.18  | 20,290.18  | -  |
| 002840              | 华统股份 | 2016/12/29 | 2017/01/10 | 新股未上市  | 6.55  | 6.55   | 1,814        | 11,881.70  | 11,881.70  | -  |
| 002838              | 道恩股份 | 2016/12/28 | 2017/01/06 | 新股未上市  | 15.28 | 15.28  | 681          | 10,405.68  | 10,405.68  | -  |
| 300586              | 美联新材 | 2016/12/26 | 2017/01/04 | 新股未上市  | 9.30  | 9.30   | 1,006        | 9,355.80   | 9,355.80   | -  |
| 300591              | 万里马  | 2016/12/30 | 2017/01/10 | 新股未上市  | 3.07  | 3.07   | 2,397        | 7,358.79   | 7,358.79   | -  |
| 300588              | 熙菱信息 | 2016/12/27 | 2017/01/05 | 新股未上市  | 4.94  | 4.94   | 1,380        | 6,817.20   | 6,817.20   | -  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订



申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期       | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股)   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002509 | 天广中茂 | 2016/09/21 | 重大事项 | 12.53  | 未知   | 未知     | 598,020 | 7,391,705.60 | 7,493,190.60 | -  |

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 149,918,487.52 元，属于第二层次的余额为 80,968,302.57 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 179,989,763.69 元，第二层次 126,829,053.16 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活

跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额  
无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具  
于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

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

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 157,740,219.29 | 60.33         |
|    | 其中:股票             | 157,740,219.29 | 60.33         |
| 2  | 固定收益投资            | 73,146,570.80  | 27.98         |
|    | 其中:债券             | 73,146,570.80  | 27.98         |
|    | 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          | 15,000,000.00  | 5.74          |
|    | 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      | 13,691,953.69  | 5.24          |

|   |        |                |        |
|---|--------|----------------|--------|
| 7 | 其他各项资产 | 1,875,296.75   | 0.72   |
| 8 | 合计     | 261,454,040.53 | 100.00 |

## 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         | 5,428,219.00   | 2.13         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 113,029,507.26 | 44.37        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,160,359.12   | 2.03         |
| E  | 建筑业              | 24,529,095.35  | 9.63         |
| F  | 批发和零售业           | 5,608,128.86   | 2.20         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,878,129.70   | 1.52         |
| J  | 金融业              | 106,780.00     | 0.04         |
| K  | 房地产业             | -              | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 157,740,219.29 | 61.92        |

**8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

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  | 000400 | 许继电气 | 471,600   | 8,559,540.00 | 3.36         |
| 2  | 000639 | 西王食品 | 328,492   | 7,972,500.84 | 3.13         |
| 3  | 000018 | 神州长城 | 741,280   | 7,931,696.00 | 3.11         |
| 4  | 002353 | 杰瑞股份 | 371,000   | 7,531,300.00 | 2.96         |
| 5  | 002509 | 天广中茂 | 598,020   | 7,493,190.60 | 2.94         |
| 6  | 002332 | 仙琚制药 | 571,337   | 7,353,107.19 | 2.89         |
| 7  | 002053 | 云南能投 | 368,800   | 7,077,272.00 | 2.78         |
| 8  | 002456 | 欧菲光  | 181,152   | 6,209,890.56 | 2.44         |
| 9  | 600567 | 山鹰纸业 | 1,590,100 | 5,756,162.00 | 2.26         |
| 10 | 000998 | 隆平高科 | 253,300   | 5,428,219.00 | 2.13         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（[www.cifm.com](http://www.cifm.com)）的年度报告正文。

**8.4 报告期内股票投资组合的重大变动****8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 000018 | 神州长城 | 17,075,076.40 | 5.34           |
| 2  | 002503 | 搜于特  | 14,734,919.07 | 4.61           |
| 3  | 002380 | 科远股份 | 13,512,342.91 | 4.23           |
| 4  | 300302 | 同有科技 | 13,504,298.20 | 4.22           |
| 5  | 300479 | 神思电子 | 12,276,881.14 | 3.84           |
| 6  | 300351 | 永贵电器 | 10,912,783.62 | 3.41           |
| 7  | 600477 | 杭萧钢构 | 10,134,519.41 | 3.17           |
| 8  | 002631 | 德尔未来 | 9,160,296.20  | 2.87           |
| 9  | 002341 | 新纶科技 | 8,969,039.51  | 2.81           |
| 10 | 002001 | 新和成  | 8,820,169.15  | 2.76           |
| 11 | 300360 | 炬华科技 | 8,672,345.14  | 2.71           |
| 12 | 002456 | 欧菲光  | 8,644,868.26  | 2.70           |
| 13 | 300221 | 银禧科技 | 8,642,944.50  | 2.70           |
| 14 | 300197 | 铁汉生态 | 8,527,071.00  | 2.67           |
| 15 | 300073 | 当升科技 | 8,338,708.52  | 2.61           |
| 16 | 000639 | 西王食品 | 8,204,504.64  | 2.57           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 17 | 002191 | 劲嘉股份 | 8,113,041.00 | 2.54 |
| 18 | 603799 | 华友钴业 | 8,104,242.35 | 2.54 |
| 19 | 002626 | 金达威  | 8,090,513.01 | 2.53 |
| 20 | 002582 | 好想你  | 7,979,616.27 | 2.50 |
| 21 | 002332 | 仙琚制药 | 7,815,393.52 | 2.44 |
| 22 | 000400 | 许继电气 | 7,813,446.00 | 2.44 |
| 23 | 002353 | 杰瑞股份 | 7,442,163.75 | 2.33 |
| 24 | 002509 | 天广中茂 | 7,391,705.60 | 2.31 |
| 25 | 002546 | 新联电子 | 7,291,360.93 | 2.28 |
| 26 | 300231 | 银信科技 | 7,258,557.20 | 2.27 |
| 27 | 002245 | 澳洋顺昌 | 7,237,570.81 | 2.26 |
| 28 | 300198 | 纳川股份 | 7,133,568.83 | 2.23 |
| 29 | 300408 | 三环集团 | 7,066,361.50 | 2.21 |
| 30 | 002519 | 银河电子 | 6,973,578.30 | 2.18 |
| 31 | 002518 | 科士达  | 6,938,640.69 | 2.17 |
| 32 | 600491 | 龙元建设 | 6,819,873.50 | 2.13 |
| 33 | 600529 | 山东药玻 | 6,779,807.91 | 2.12 |
| 34 | 603026 | 石大胜华 | 6,760,443.58 | 2.11 |
| 35 | 300144 | 宋城演艺 | 6,708,633.40 | 2.10 |
| 36 | 600073 | 上海梅林 | 6,619,381.30 | 2.07 |
| 37 | 002053 | 云南能投 | 6,610,401.90 | 2.07 |
| 38 | 002640 | 跨境通  | 6,521,222.87 | 2.04 |

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

#### 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  | 000018 | 神州长城 | 20,929,029.31 | 6.55               |
| 2  | 002709 | 天赐材料 | 13,950,838.76 | 4.36               |
| 3  | 002546 | 新联电子 | 13,202,275.51 | 4.13               |
| 4  | 300302 | 同有科技 | 12,797,136.71 | 4.00               |
| 5  | 002380 | 科远股份 | 12,601,883.04 | 3.94               |
| 6  | 002503 | 搜于特  | 12,551,638.66 | 3.93               |
| 7  | 300479 | 神思电子 | 12,091,866.70 | 3.78               |
| 8  | 300203 | 聚光科技 | 12,060,668.31 | 3.77               |
| 9  | 300351 | 永贵电器 | 11,845,938.40 | 3.71               |
| 10 | 002640 | 跨境通  | 10,143,407.71 | 3.17               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 11 | 300072 | 三聚环保 | 9,726,083.79 | 3.04 |
| 12 | 300065 | 海兰信  | 9,368,536.59 | 2.93 |
| 13 | 300025 | 华星创业 | 9,288,839.92 | 2.91 |
| 14 | 002631 | 德尔未来 | 9,228,529.42 | 2.89 |
| 15 | 002001 | 新和成  | 9,202,401.80 | 2.88 |
| 16 | 603799 | 华友钴业 | 9,128,320.91 | 2.86 |
| 17 | 002582 | 好想你  | 9,113,292.06 | 2.85 |
| 18 | 002466 | 天齐锂业 | 8,919,548.08 | 2.79 |
| 19 | 300221 | 银禧科技 | 8,905,607.17 | 2.79 |
| 20 | 600271 | 航天信息 | 8,887,789.14 | 2.78 |
| 21 | 300073 | 当升科技 | 8,592,337.40 | 2.69 |
| 22 | 300360 | 炬华科技 | 8,462,718.09 | 2.65 |
| 23 | 300408 | 三环集团 | 8,431,355.79 | 2.64 |
| 24 | 002518 | 科士达  | 7,981,543.52 | 2.50 |
| 25 | 300109 | 新开源  | 7,960,570.32 | 2.49 |
| 26 | 002626 | 金达威  | 7,810,139.48 | 2.44 |
| 27 | 002245 | 澳洋顺昌 | 7,517,102.13 | 2.35 |
| 28 | 300231 | 银信科技 | 7,327,501.89 | 2.29 |
| 29 | 600491 | 龙元建设 | 7,317,660.37 | 2.29 |
| 30 | 300198 | 纳川股份 | 7,043,778.13 | 2.20 |
| 31 | 600477 | 杭萧钢构 | 6,967,557.47 | 2.18 |
| 32 | 300322 | 硕贝德  | 6,955,754.12 | 2.18 |
| 33 | 600073 | 上海梅林 | 6,944,005.03 | 2.17 |
| 34 | 002519 | 银河电子 | 6,778,769.76 | 2.12 |
| 35 | 300144 | 宋城演艺 | 6,762,460.52 | 2.12 |
| 36 | 603026 | 石大胜华 | 6,745,368.07 | 2.11 |
| 37 | 002343 | 慈文传媒 | 6,671,855.15 | 2.09 |
| 38 | 300011 | 鼎汉技术 | 6,409,158.56 | 2.00 |

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

#### 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 | 918,191,950.87 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 954,279,478.36 |

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

**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      | -             | -            |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 10,000,000.00 | 3.93         |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,000,000.00 | 3.93         |
| 4  | 企业债券      | 63,146,570.80 | 24.79        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -             | -            |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 73,146,570.80 | 28.71        |

**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  | 160401 | 16 农发 01 | 100,000 | 10,000,000.00 | 3.93         |
| 2  | 136377 | 16 泰玻债   | 50,000  | 4,848,500.00  | 1.90         |
| 3  | 136490 | 16 红美 01 | 50,000  | 4,837,500.00  | 1.90         |
| 4  | 136487 | 16 月星 02 | 40,000  | 3,984,000.00  | 1.56         |
| 5  | 122607 | 12 渝地产   | 50,000  | 3,131,500.00  | 1.23         |

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.12 投资组合报告附注**

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

8.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在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   | 86,302.16    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,772,621.11 |
| 5  | 应收申购款   | 16,373.48    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,875,296.75 |

**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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1  | 002509 | 天广中茂 | 7,493,190.60 | 2.94         | 筹划重大事项   |

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |        |                |        |
|----------|-----------|--------------|--------|----------------|--------|
|          |           | 机构投资者        |        | 个人投资者          |        |
|          |           | 持有份额         | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 7,050    | 22,015.39 | 1,677,641.10 | 1.08%  | 153,530,869.37 | 98.92% |

## 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本基金 | -         | -        |

## 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 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2008年5月21日)基金份额总额 | 1,423,318,139.20 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 156,363,843.94   |
| 本报告期基金总申购份额               | 30,283,328.18    |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 31,438,661.65    |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 155,208,510.47   |

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

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**

基金管理人：

本公司于 2016 年 2 月 3 日发布公告：因届龄退休，陈开元先生自 2016 年 2 月 2 日起不再担任本公司董事长，由穆矢先生担任本公司董事长。

本公司于 2016 年 7 月 6 日发布公告：因个人原因，经晓云女士自 2016 年 7 月 4 日起不再担任本公司副总经理。

本公司于 2016 年 9 月 24 日发布公告：因个人原因，侯明甫先生自 2016 年 9 月 22 日起不再担任本公司副总经理。聘任杜猛先生、孙芳女士和郭鹏先生为本公司副总经理。

本公司于 2016 年 11 月 5 日发布公告：自 2016 年 11 月 4 日起，聘任杨红女士为本公司副总经理。

基金托管人：

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**

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**11.4 基金投资策略的改变**

报告期内无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，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 60,000 元。目前的审计机构已提供审计服务的连续年限为 9 年。

### 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

报告期内，管理人、托管人未受稽查或处罚，亦未发现管理人、托管人的高级管理人员受稽查或处罚。

### 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<br>比例 | 佣金         | 占当期佣金总量的<br>比例 |    |
| 海通证券 | 1      | 989,013,904.74 | 52.93%           | 921,070.31 | 52.93%         | -  |
| 安信证券 | 1      | 456,102,352.65 | 24.41%           | 424,770.02 | 24.41%         | -  |
| 东方证券 | 1      | 347,209,240.05 | 18.58%           | 323,355.68 | 18.58%         | -  |
| 中银国际 | 1      | 76,183,929.03  | 4.08%            | 70,951.18  | 4.08%          | -  |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

#### 2. 交易单元的选择标准：

- 1) 资本金雄厚,信誉良好。
- 2) 财务状况良好,经营行为规范。
- 3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服

务。

- 5) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

#### 3. 交易单元的选择程序：

- 1) 本基金管理人定期召开会议，组织相关部门依据交易单元的选择标准对交易单元候选券商进行评估，确定选用交易单元的券商。

2) 本基金管理人与券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

4. 2016年度本基金无新增席位，无注销席位。

#### 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<br>比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总<br>额的比例 | 成交金<br>额 | 占当期权<br>证成交总<br>额的比例 |
| 海通证券 | 4,964,554.66  | 10.02%           | -              | -                | -        | -                    |
| 安信证券 | 2,450,557.31  | 4.95%            | -              | -                | -        | -                    |
| 东方证券 | 32,378,365.04 | 65.35%           | 367,000,000.00 | 69.11%           | -        | -                    |
| 中银国际 | 9,750,851.07  | 19.68%           | 164,000,000.00 | 30.89%           | -        | -                    |

上投摩根基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日