

光大保德信新增长混合型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	42
8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	43
9 开放式基金份额变动	43
10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
11 影响投资者决策的其他重要信息	47
12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信新增长混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信新增长混合
基金主代码	360006
交易代码	360006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月14日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	214,922,490.67 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，为投资者获取稳定的收益。
投资策略	本基金为主动投资的混合型投资基金，强调投资于符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，追求长期投资回报。
业绩比较基准	75%×沪深300指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的风险较高的品种，其预期收益和风险高于债券型基金及货币市场基金。

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		光大保德信基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	魏丹	张燕
	联系电话	(021) 80262888	0755-83199084
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008-202-888	95555
传真		(021) 80262468	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层至10层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200010	518040

法定代表人	林昌	李建红
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金半年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、招商银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	10,222,675.65
本期利润	15,102,026.45
加权平均基金份额本期利润	0.0687
本期加权平均净值利润率	6.36%
本期基金份额净值增长率	6.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	22,838,553.66
期末可供分配基金份额利润	0.1063
期末基金资产净值	238,900,552.68
期末基金份额净值	1.1116
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	270.64%

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

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

（3）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
过去一个月	8.10%	0.87%	3.97%	0.51%	4.13%	0.36%
过去三个月	0.28%	0.91%	4.60%	0.47%	-4.32%	0.44%
过去六个月	6.56%	0.80%	7.99%	0.43%	-1.43%	0.37%
过去一年	10.54%	0.81%	12.15%	0.51%	-1.61%	0.30%
过去三年	52.06%	2.03%	56.45%	1.31%	-4.39%	0.72%
自基金合同生效起至今	270.64%	1.78%	141.33%	1.40%	129.31%	0.38%

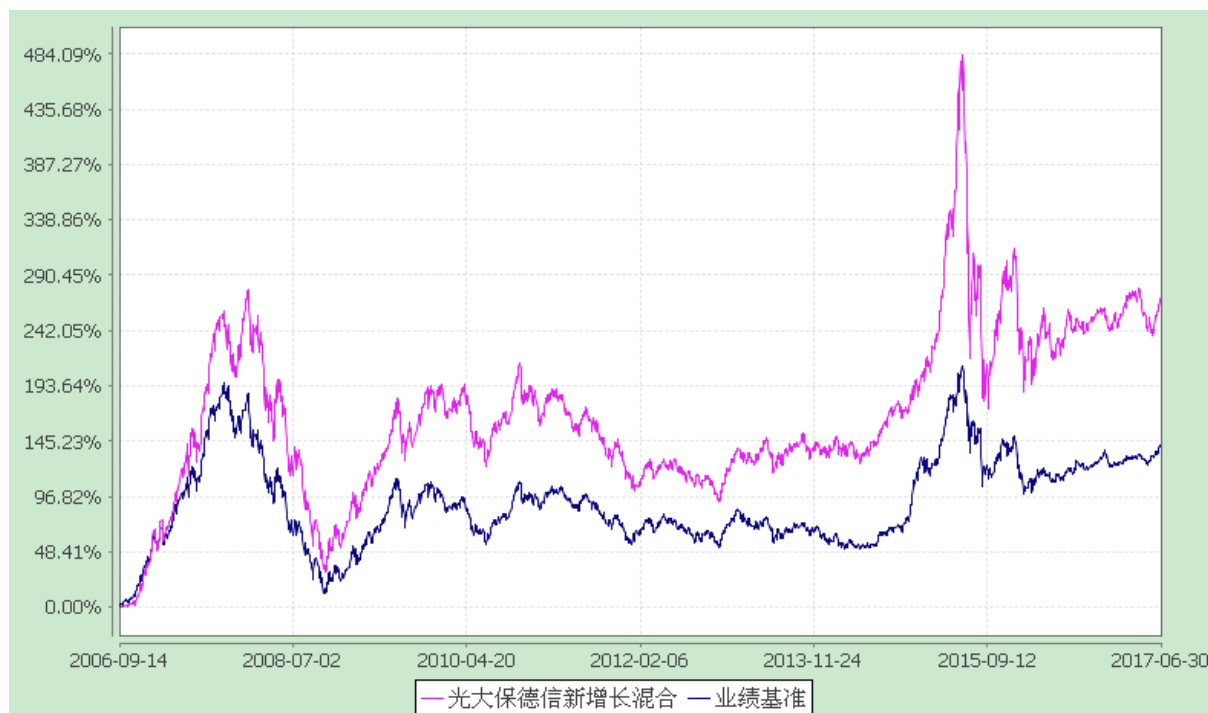
注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×富时中国 A200 成长指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”变更为“75%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”。

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

光大保德信新增长混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2006 年 9 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：1、为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×富时中国 A200 成长指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”变更为“75%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率”。

2、根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2006 年 9 月 14 日至 2007 年 3 月 13 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2017 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 37 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资

资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏晓雪	研究部总监、基金经理	2013-02-28	-	13 年	魏晓雪女士，硕士，2003 年毕业于浙江大学，获经济学学士学位。2015 年获得复旦大学经济学硕士学位。2006 年 10 月至 2009 年 9 月曾在鹏远（北京）管理咨询有限公司上海分公司（原凯基管理咨询有限公司）担任研究员；2009 年 10 月加入光大保德信基金管理有限公司担任高级研究员。2012 年 11 月 15 日起担任光大保德信行业轮动股票型证券投资基金基金经理。现任研究部总监兼光大保德信新增长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别为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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有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 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

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

2017 年一季度，国内宏观经济整体上延续了 16 年四季度的向好趋势，且叠加全球贸易回暖背景，出现了内外需两旺局面。PMI 自 16 年 10 月以来，持续维持在 51 以上的位置已超过 6 个月，为 12 年以来少见的局面。1-2 月基建投资增速同比增长 21.3%，较 16 年全年有所提升，与开工项目去年底集中投资有关。房地产一季度销售数据略有回升，且三四线城市热度明显超预期。1-2 月商品房销售面积同比增长 25%，去年四季度为 14%。且由于基数原因，2 月份 CPI 回落至 1 以下。2017 年一季度，统计局公布的季度 GDP 增速高达 6.9%，创 1 年半反弹新高，工业增加值增速也在 2-3 月调升至 8% 左右的高位。

进入二季度，工业增速有所回落，但依然维持在 6.5% 左右的相对高位。PMI 自 16 年 10 月以来，持续维持在 51 以上的位置已超过 9 个月，为 12 年以来非常少见的局面。房地产销售数据继续回落，三线城市表现依旧好于一、二线，相关政策依然吃紧。

一季度股票先延续了 12 月份的回调趋势，且以创业板跌幅为首，春节过后，伴随经济持续回暖，大盘逐步走出底部。2017 年一季度，上证综指和沪深 300 分别上涨了 3.83% 和 4.41%，主要指数中，表现最好的为上证红利指数，上涨了 6.8%。值得关注的是，中小板指和创业板指走出了分化趋势，

中小板指上涨了 4.22%，而创业板指下跌了 2.79%。

从行业分布来看，一季度表现最好的行业为家电、食品饮料及煤炭，单季度分别录得了 13.3%、9%和 7.3%以上的涨幅。跌幅较大的行业为计算机、纺织服装及农业，其中计算机实现了超过 5%以上的跌幅。

二季度股票在上证 3300 点附近的高位开盘，震荡数周开始了漫漫下跌，曾实现了历史上少见的周线五连阴，5 月中见底后缓慢抬升。2017 年二季度，上证综指略跌了 0.94%，沪深 300 上涨了 6.1%，主要指数中，表现最好的为上证 50 指数，上涨了 8.06%。中小板指和创业板指继续分化，中小板指上涨了 2.98%，而创业板指下跌了 4.68%。

从行业分布来看，二季度表现最好的行业为家电、食品饮料及非银行金融，单季度分别录得了 14.4%、9.2%和 8.7%以上的涨幅。跌幅较大的行业为国防军工、农业及机械，其中军工实现了接近 15%的跌幅。

本基金一季度的操作中，季初延续了 12 月的降仓，维持了较低仓位，春节前后进行了明确的加仓。在 1-2 月份，本基金持仓以周期板块为主，重配了如石油石化、钢铁、煤炭等板块。3 月份开始，逐步减持周期股，增加了以电子、新能源汽车为代表的成长型个股。一季度操作较为不满意之处在于低配了家电及建筑建材板块，对地产产业链及政策投资相关的机会，如一带一路等仍需重视。二季度的操作中，基本维持在了中性偏高仓位，仓位调整不多。持仓结构上，季度初由于忽视了消费，尤其是白酒白电的强势，而加配了以电子、新能源汽车为代表的成长型行业，导致基金收益率回落明显。季度中期调整持仓至以消费为主，辅以新能源汽车及电子的成长板块，及以建筑为主的中游周期板块，降低了机械及高估值成长板块配置，在季度末的时候加配了钢铁、煤炭、造纸等中游偏周期板块。本基金在个股选择上始终坚持综合评估企业的盈利能力、成长性和估值水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 6.56%，业绩比较基准收益率为 7.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于对地产周期的预判，资本市场多数参与者对于 2017 年下半年经济走势持相当谨慎态度，且预期充分。但对基础数据仔细观察，且考虑到海外经济情况较好的背景，2017 年下半年宏观经济走势有可能依然维持在二季度的较高水平上震荡，经济下行斜率或较为缓慢。换句话说，我们认为，从预期角度来看，经济向上的风险和向下的风险是等同的，向下概率大但预期非常充分，而经济只要维持即意味着向上超预期。若农产品没有异动，下半年通胀仍无需担忧。

因此，纵观下半年的投资机会依然围绕以下几个主题：

由于供给侧改革推进或过去几年环保压力持续发酵带来的，部分工业品、周期品价格持续上涨，引致相关企业盈利持续改善，且在新增产能尚未出现在市场时，预判企业尚未到达季度盈利高点，加之对其估值的考量，我们认为相关行业仍具投资价值，具有代表性的行业如：钢铁、造纸、铝、稀土等。但相关企业一旦达到季度盈利高点，或估值发酵到位时，投资性价比将大为降低。同时，我们密切关注，由于上游价格及盈利复苏，带来的中游制造装备业复苏的投资机会。

在成长方面，我们非常重视新能源汽车板块的发展，这是未来几年最为确定的成长行业之一。我们预计，全球新能源汽车的销量未来将以超过 25% 以上的增速增长，保守预估到 2020 年全球新能源汽车销量将超过 200 万辆，而汽车又是均价超过 10 万的产品，为规模超过千万的产业，且中国企业很早即已布局，其中必有较大投资机会出现，我们始终密切关注并积极布局。另外，我们持续关注消费电子及汽车电子方面的创新。

价值及消费方面，我们将持续布局在估值合理，竞争优势明显、公司治理优秀的企业。家电、白酒、医药、零售、旅游等行业我们始终在关注。白酒行业由于茅台一批价在过去一年中显著上涨，幅度超过 50%，必然会使得未来一年二三线酒的经营环境明显好转。白电企业估值尚不能说贵，其估值修复之路是否结束尚待观察。医药、旅游、零售行业的基本面均有亮点出现，但估值尚需修复及等待，我们密切关注其投资机会的变化。

下半年风险隐忧在于政策相对不清晰，18 年经济下滑预期及流动性风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表（包括权益、固定收益业务板块）、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论特别估值方案，同时审慎平衡托管行、审计师意见和基金同业的惯常做法，与托管行沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会提交建议一般需获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者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，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信新增长混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	10,718,965.51	16,827,412.73
结算备付金		853,843.29	12,447,355.87
存出保证金		106,584.90	189,092.20
交易性金融资产	6.4.7.2	211,547,077.75	205,860,331.38
其中：股票投资		211,547,077.75	195,989,463.38
基金投资		-	-
债券投资		-	9,870,868.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	16,000,000.00	5,000,000.00
应收证券清算款		756,274.30	-
应收利息	6.4.7.5	-2,392.03	10,572.48
应收股利		-	-
应收申购款		18,931.35	8,224.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		239,999,285.07	240,342,989.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,774,736.16
应付赎回款		302,300.05	30,439.81

应付管理人报酬	6.4.10.2	284,256.43	297,097.97
应付托管费	6.4.10.2	47,376.09	49,516.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	285,791.26	421,757.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	179,008.56	360,027.84
负债合计		1,098,732.39	6,933,575.15
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	214,922,490.67	223,733,834.13
未分配利润	6.4.7.10	23,978,062.01	9,675,580.08
所有者权益合计		238,900,552.68	233,409,414.21
负债和所有者权益总计		239,999,285.07	240,342,989.36

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1116 元，基金份额总额 214,922,490.67 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信新增长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		18,391,822.59	-65,078,214.62
1.利息收入		212,132.89	162,010.52
其中：存款利息收入	6.4.7.11	72,110.58	91,106.57
债券利息收入		18,717.51	16,240.48
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		121,304.80	54,663.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,290,920.02	-52,073,763.29
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,311,445.27	-53,439,680.67
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-644,207.08	16,468.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	1,623,681.83	1,349,449.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	4,879,350.80	-13,254,147.85
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	9,418.88	87,686.00
减：二、费用		3,289,796.14	4,118,598.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,764,317.00	2,077,985.39
2. 托管费	6.4.10.2	294,052.83	346,330.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	1,031,182.82	1,493,513.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.22	200,243.49	200,768.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,102,026.45	-69,196,812.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,102,026.45	-69,196,812.97

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信新增长混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	223,733,834.13	9,675,580.08	233,409,414.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,102,026.45	15,102,026.45
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）	-8,811,343.46	-799,544.52	-9,610,887.98
其中：1.基金申购款	7,979,020.94	671,940.36	8,650,961.30
2.基金赎回款	-16,790,364.40	-1,471,484.88	-18,261,849.28
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	214,922,490.67	23,978,062.01	238,900,552.68
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	227,035,559.89	195,649,034.36	422,684,594.25

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-69,196,812.97	-69,196,812.97
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）	-29,921,466.80	-12,757,899.99	-42,679,366.79
其中：1.基金申购款	49,158,921.33	24,795,697.09	73,954,618.42
2.基金赎回款	-79,080,388.13	-37,553,597.08	-116,633,985.21
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）	-	-49,616,472.23	-49,616,472.23
五、期末所有者权益（基金净值）	197,114,093.09	64,077,849.17	261,191,942.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：包爱丽，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信新增长混合型证券投资基金（原名光大保德信新增长股票型证券投资基金以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]129 号文《关于同意光大保德信新增长股票型投资基金募集的批复》的核准，由光大保德信基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 9 月 14 日正式生效，首次设立募集规模为 409,913,619.78 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记人为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为主动投资的混合型投资基金，强调投资于符合国家经济新增长模式且具有长期发展潜力的上市公司，追求长期投资回报。本基金股票资产占基金资产不少于 60%，最高可达基金资产 90%，其余资产除应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券外，还可投资于中国证监会认可的其他金融工具，包括但不限于债券、可转债、央行票据、回购、权证等。本基金的业绩比较基准为 75%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数+5%×银行同业存款利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会

计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2、营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，

暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4、 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	10,718,965.51
定期存款	-
其他存款	-
合计	10,718,965.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		209,781,933.11	211,547,077.75	1,765,144.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		209,781,933.11	211,547,077.75	1,765,144.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上海证券交易所市场	16,000,000.00	-
合计	16,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,666.93
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	384.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-5,506.03
应收申购款利息	14.87

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	48.00
合计	-2,392.03

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	285,791.26
银行间市场应付交易费用	-
合计	285,791.26

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	490.07
其他	-
预提费用	178,518.49
合计	179,008.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,733,834.13	223,733,834.13
本期申购	7,979,020.94	7,979,020.94
本期赎回（以“-”号填列）	-16,790,364.40	-16,790,364.40
本期末	214,922,490.67	214,922,490.67

注：注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	13,538,101.23	-3,862,521.15	9,675,580.08
本期利润	10,222,675.65	4,879,350.80	15,102,026.45
本期基金份额交易产生的变动数	-922,223.22	122,678.70	-799,544.52
其中：基金申购款	789,150.09	-117,209.73	671,940.36
基金赎回款	-1,711,373.31	239,888.43	-1,471,484.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,838,553.66	1,139,508.35	23,978,062.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	60,410.43
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	10,610.26
其他	1,089.89
合计	72,110.58

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	346,266,436.92
减：卖出股票成本总额	333,954,991.65
买卖股票差价收入	12,311,445.27

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-644,207.08
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	-644,207.08
----	-------------

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,450,548.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,074,087.39
减：应收利息总额	20,667.84
买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-644,207.08

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末进行资产支持证券投资。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期末进行衍生工具投资。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,623,681.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,623,681.83

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	4,879,350.80
——股票投资	4,676,131.41
——债券投资	203,219.39
——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	4,879,350.80

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	8,350.88
转换费收入	1,068.00
合计	9,418.88

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	1,031,182.82
银行间市场交易费用	-
合计	1,031,182.82

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	2,925.00
账户维护费	18,000.00
其他费用	800.00
合计	200,243.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司（简称“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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
光大证券	25,427,876.30	3.70%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期和上年度可比期间均未与关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
光大证券	114,000,000.00	18.01%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	23,680.65	3.80%	23,680.65	8.29%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	-	-	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,764,317.00
其中：支付销售机构的客户维护费	305,852.88	352,292.01

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人于次月首日起三个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人在收到计算结果当日完成复核,并于当日从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	294,052.83	346,330.94

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，基金管理人应于次月首日起三个工作日内将上月基金托管费的计算结果书面通知基金托管人并作出划付指令，基金托管人复核后于当日从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期以及上年度可比期间未做银行间市场债券（含回购）的关联交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	10,718,965.51	60,410.43	13,125,000.46	75,476.30

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期和上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	16,000.00	286,600.00	278,400.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21	-	-	330,000.00	2,508,600.00	2,049,300.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	6.85	2017-08-21	8.22	1,000.00	7,880.00	6,850.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

本基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统，可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息，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；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。

6.4.13.3 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。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。

本基金管理人风险管理部门从资产配置、行业配置、个股选择等层面制定相应的流动性指标，设定相应的预警阈值，并通过风险评估系统对这些流动性指标进行持续的监测、评估，根据评估结果及时提出流动性风险管理建议。

本基金管理人通过设定对单一证券的投资比例限制，建立相应的授权审批制度，在保护基金持有人利益最大化的前提下，有效管理基金因在单一证券投资比例过高所带来的个股流动性风险。

本基金管理人通过制定流通受限证券的投资流程及风险处置预案，有效管理基金投资流通受限证券所承受的流动性风险。

本基金管理人通过分析本基金持有人结构、密切跟踪监控基金申购赎回趋势，有效预测本基金的流动性需求。同时，本基金管理人通过进行基金变现能力测试得出基金在各市场情形下的变现能力，通过情景分析及压力测试，评估基金在极端情形下面临的流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 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。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证保证金及债券投资等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	10,718,965.51	-	-	-	-	-	10,718,965.51
结算备付金	853,843.29	-	-	-	-	-	853,843.29
存出保证金	106,584.90	-	-	-	-	-	106,584.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	211,547,077.75	211,547,077.75
买入返售金融资产	16,000,000.00	-	-	-	-	-	16,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	756,274.30	756,274.30
应收利息	-	-	-	-	-	-2,392.03	-2,392.03
应收申购款	-	-	-	-	-	18,931.35	18,931.35
资产总计	27,679,393.70	-	-	-	-	212,319,891.37	239,999,285.07
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	302,300.05	302,300.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	284,256.43	284,256.43
应付托管费	-	-	-	-	-	47,376.09	47,376.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	285,791.26	285,791.26
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	179,008.56	179,008.56
负债总计	-	-	-	-	-	1,098,732.39	1,098,732.39
利率敏感度缺口	27,679,393.70	-	-	-	-	211,221,158.98	238,900,552.68
上年度末 2016年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	16,827,412.73	-	-	-	-	-	16,827,412.73
结算备付金	12,447,355.87	-	-	-	-	-	12,447,355.87
存出保证金	189,092.20	-	-	-	-	-	189,092.20

交易性金融资产	-	-	9,870,868.00	-	-	195,989,463.38	205,860,331.38
买入返售金融资产	5,000,000.00	-	-	-	-	-	5,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	10,572.48	10,572.48
应收申购款	-	-	-	-	-	8,224.70	8,224.70
资产总计	34,463,860.80	-	9,870,868.00	-	-	196,008,260.56	240,342,989.36
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,774,736.16	5,774,736.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,439.81	30,439.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	297,097.97	297,097.97
应付托管费	-	-	-	-	-	49,516.32	49,516.32
应付交易费用	-	-	-	-	-	421,757.05	421,757.05
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	360,027.84	360,027.84
负债总计	-	-	-	-	-	6,933,575.15	6,933,575.15
利率敏感度缺口	34,463,860.80	-	9,870,868.00	-	-	189,074,685.41	233,409,414.21

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券，因此无重大利率风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场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市场价格风险，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。

本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市

场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	211,547,077.75	88.55	195,989,463.38	83.97
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	9,870,868.00	4.23
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	211,547,077.75	88.55	205,860,331.38	88.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 310	增加约 371
	业绩比较基准下降 1%	减少约 310	减少约 371

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金无需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	211,547,077.75	88.14
	其中：股票	211,547,077.75	88.14
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	16,000,000.00	6.67
	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	11,572,808.80	4.82
7	其他各项资产	879,398.52	0.37
8	合计	239,999,285.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	272,200.00	0.11
B	采矿业	4,969,100.00	2.08
C	制造业	160,294,738.93	67.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,151,400.00	5.50
F	批发和零售业	5,116,439.20	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	4,757,650.00	1.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,772,297.62	1.16

J	金融业	-	-
K	房地产业	218,980.00	0.09
L	租赁和商务服务业	8,290,576.00	3.47
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,741,800.00	1.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	283,496.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	6,678,400.00	2.80
S	综合	-	-
	合计	211,547,077.75	88.55

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002568	百润股份	518,000	8,609,160.00	3.60
2	300058	蓝色光标	1,060,000	8,289,200.00	3.47
3	000651	格力电器	200,000	8,234,000.00	3.45
4	002050	三花智控	500,000	8,160,000.00	3.42
5	600885	宏发股份	200,000	7,978,000.00	3.34
6	002242	九阳股份	400,000	7,868,000.00	3.29
7	601668	中国建筑	750,000	7,260,000.00	3.04
8	000596	古井贡酒	138,013	7,031,762.35	2.94
9	002250	联化科技	480,000	6,864,000.00	2.87
10	300144	宋城演艺	320,000	6,678,400.00	2.80
11	600516	方大炭素	400,000	5,688,000.00	2.38
12	600887	伊利股份	240,000	5,181,600.00	2.17
13	600699	均胜电子	160,000	5,134,400.00	2.15
14	600782	新钢股份	1,369,984	5,000,441.60	2.09
15	002078	太阳纸业	680,000	4,998,000.00	2.09
16	000488	晨鸣纸业	380,000	4,902,000.00	2.05
17	603883	老百姓	100,008	4,865,389.20	2.04
18	603989	艾华集团	120,000	4,708,800.00	1.97
19	000049	德赛电池	88,000	4,559,280.00	1.91
20	002205	国统股份	165,000	4,527,600.00	1.90
21	000063	中兴通讯	170,000	4,035,800.00	1.69
22	600867	通化东宝	216,000	3,939,840.00	1.65
23	600176	中国巨石	320,000	3,513,600.00	1.47

24	600183	生益科技	270,000	3,331,800.00	1.39
25	000022	深赤湾 A	95,000	2,826,250.00	1.18
26	600879	航天电子	300,000	2,637,000.00	1.10
27	601100	恒立液压	160,000	2,606,400.00	1.09
28	600282	南钢股份	700,000	2,597,000.00	1.09
29	002332	仙琚制药	300,000	2,580,000.00	1.08
30	300355	蒙草生态	240,000	2,577,600.00	1.08
31	601225	陕西煤业	360,000	2,545,200.00	1.07
32	000568	泸州老窖	50,000	2,529,000.00	1.06
33	600581	八一钢铁	250,000	2,517,500.00	1.05
34	600038	中直股份	55,000	2,517,350.00	1.05
35	000898	鞍钢股份	440,000	2,490,400.00	1.04
36	601898	中煤能源	410,000	2,410,800.00	1.01
37	002108	沧州明珠	180,000	2,403,000.00	1.01
38	002466	天齐锂业	44,000	2,391,400.00	1.00
39	002405	四维图新	120,000	2,371,200.00	0.99
40	600491	龙元建设	220,000	2,360,600.00	0.99
41	600068	葛洲坝	210,000	2,360,400.00	0.99
42	002570	贝因美	170,000	2,312,000.00	0.97
43	300207	欣旺达	190,000	2,240,100.00	0.94
44	002138	顺络电子	120,000	2,229,600.00	0.93
45	601989	中国重工	330,000	2,049,300.00	0.86
46	000978	桂林旅游	220,000	2,037,200.00	0.85
47	601000	唐山港	370,000	1,931,400.00	0.81
48	600563	法拉电子	30,000	1,482,300.00	0.62
49	000333	美的集团	32,000	1,377,280.00	0.58
50	600418	江淮汽车	130,000	1,371,500.00	0.57
51	601636	旗滨集团	300,000	1,353,000.00	0.57
52	601231	环旭电子	80,000	1,256,800.00	0.53
53	002310	东方园林	70,000	1,170,400.00	0.49
54	000030	富奥股份	80,000	715,200.00	0.30
55	002553	南方轴承	50,000	584,000.00	0.24
56	603008	喜临门	30,000	534,300.00	0.22
57	002180	纳思达	20,000	483,200.00	0.20
58	600666	奥瑞德	16,000	278,400.00	0.12
59	002714	牧原股份	10,000	272,200.00	0.11
60	002697	红旗连锁	40,000	242,800.00	0.10
61	300347	泰格医药	10,000	242,000.00	0.10
62	603355	莱克电气	4,000	235,080.00	0.10
63	600585	海螺水泥	10,000	227,300.00	0.10
64	601155	新城控股	10,000	185,400.00	0.08
65	600588	用友网络	10,000	171,200.00	0.07
66	002422	科伦药业	10,000	165,200.00	0.07
67	600196	复星医药	5,000	154,950.00	0.06

68	300618	寒锐钴业	1,600	150,880.00	0.06
69	300358	楚天科技	10,000	142,700.00	0.06
70	600110	诺德股份	10,000	140,900.00	0.06
71	002368	太极股份	5,000	138,450.00	0.06
72	000888	峨眉山 A	10,000	127,000.00	0.05
73	603833	欧派家居	1,000	109,860.00	0.05
74	600089	特变电工	10,000	103,300.00	0.04
75	600398	海澜之家	10,000	94,900.00	0.04
76	002216	三全食品	10,000	86,100.00	0.04
77	300136	信维通信	2,000	80,040.00	0.03
78	603338	浙江鼎力	1,000	65,930.00	0.03
79	002523	天桥起重	12,000	63,840.00	0.03
80	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
81	600519	贵州茅台	100	47,185.00	0.02
82	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
83	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
84	000820	神雾节能	1,000	37,980.00	0.02
85	600340	华夏幸福	1,000	33,580.00	0.01
86	300156	神雾环保	1,000	32,760.00	0.01
87	300244	迪安诊断	1,000	31,460.00	0.01
88	300124	汇川技术	1,000	25,540.00	0.01
89	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
90	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
91	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
92	300166	东方国信	1,600	21,488.00	0.01
93	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
94	300257	开山股份	1,000	21,080.00	0.01
95	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
96	002273	水晶光电	1,000	20,630.00	0.01
97	600456	宝钛股份	1,000	20,520.00	0.01
98	300183	东软载波	1,000	20,480.00	0.01
99	300285	国瓷材料	1,000	19,700.00	0.01
100	002439	启明星辰	1,000	18,600.00	0.01
101	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
102	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
103	002019	亿帆医药	1,000	16,680.00	0.01
104	002583	海能达	1,000	16,090.00	0.01
105	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
106	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
107	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
108	300383	光环新网	1,000	13,560.00	0.01
109	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
110	600497	驰宏锌锗	2,000	13,100.00	0.01
111	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00

112	600763	通策医疗	400	10,036.00	0.00
113	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
114	002430	杭氧股份	1,000	8,790.00	0.00
115	000417	合肥百货	1,000	8,250.00	0.00
116	600031	三一重工	1,000	8,130.00	0.00
117	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
118	002831	裕同科技	100	7,500.00	0.00
119	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
120	600050	中国联通	1,000	6,850.00	0.00
121	002436	兴森科技	1,000	6,300.00	0.00
122	300484	蓝海华腾	200	6,072.00	0.00
123	300433	蓝思科技	120	3,490.80	0.00
124	300496	中科创达	100	2,830.00	0.00
125	002262	恩华药业	160	2,420.80	0.00
126	002027	分众传媒	100	1,376.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	11,430,637.22	4.90
2	300207	欣旺达	9,405,938.35	4.03
3	300144	宋城演艺	7,909,007.24	3.39
4	600489	中金黄金	7,693,470.00	3.30
5	601668	中国建筑	7,608,825.00	3.26
6	002242	九阳股份	7,530,505.35	3.23
7	000596	古井贡酒	7,128,131.60	3.05
8	002138	顺络电子	6,848,931.70	2.93
9	000651	格力电器	6,448,649.85	2.76
10	002050	三花智控	6,344,517.00	2.72
11	002739	万达电影	5,655,440.18	2.42
12	002205	国统股份	5,494,490.00	2.35
13	603816	顾家家居	5,386,193.00	2.31
14	002108	沧州明珠	5,360,588.00	2.30
15	600699	均胜电子	5,236,434.00	2.24
16	000002	万科 A	5,163,085.00	2.21
17	000858	五粮液	5,058,924.00	2.17
18	600887	伊利股份	5,042,800.00	2.16
19	000039	中集集团	5,005,641.00	2.14
20	002078	太阳纸业	4,975,396.54	2.13

21	000049	德赛电池	4,972,691.00	2.13
22	300316	晶盛机电	4,951,083.00	2.12
23	000799	酒鬼酒	4,912,861.00	2.10
24	000568	泸州老窖	4,906,477.00	2.10
25	600782	新钢股份	4,897,855.72	2.10
26	603989	艾华集团	4,874,340.55	2.09
27	601595	上海电影	4,855,745.00	2.08
28	000488	晨鸣纸业	4,832,000.00	2.07
29	603799	华友钴业	4,743,423.00	2.03

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600282	南钢股份	14,386,161.76	6.16
2	002466	天齐锂业	12,059,387.23	5.17
3	002662	京威股份	7,823,367.00	3.35
4	600297	广汇汽车	7,049,151.23	3.02
5	000157	中联重科	6,969,700.00	2.99
6	300207	欣旺达	6,784,551.20	2.91
7	600489	中金黄金	6,553,647.26	2.81
8	600778	友好集团	6,433,315.71	2.76
9	603799	华友钴业	6,418,309.00	2.75
10	601688	华泰证券	5,736,100.00	2.46
11	600803	新奥股份	5,724,530.97	2.45
12	601998	中信银行	5,588,297.64	2.39
13	000858	五粮液	5,425,523.53	2.32
14	000039	中集集团	5,289,047.00	2.27
15	002739	万达电影	5,182,284.86	2.22
16	600259	广晟有色	5,128,652.00	2.20
17	300316	晶盛机电	5,113,670.00	2.19
18	603816	顾家家居	5,054,460.00	2.17
19	000581	威孚高科	5,046,526.12	2.16
20	601118	海南橡胶	4,934,400.00	2.11
21	000599	青岛双星	4,916,900.00	2.11
22	002438	江苏神通	4,852,927.85	2.08
23	600028	中国石化	4,822,400.00	2.07
24	600688	上海石化	4,791,700.00	2.05
25	600109	国金证券	4,728,210.00	2.03
26	000703	恒逸石化	4,695,075.00	2.01
27	600015	华夏银行	4,671,589.05	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	344,836,474.61
卖出股票的收入（成交）总额	346,266,436.92

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未投资债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未投资债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	106,584.90
2	应收证券清算款	756,274.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-2,392.03
5	应收申购款	18,931.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	879,398.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

			比例		比例
11,119	19,329.30	396,719.43	0.18%	214,525,771.24	99.82%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	193,226.45	0.09%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年9月14日）基金份额总额	409,913,619.78
本报告期期初基金份额总额	223,733,834.13
本报告期基金总申购份额	7,979,020.94
减：本报告期基金总赎回份额	16,790,364.40
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	214,922,490.67

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经公司九届十一次董事会会议审议通过，自 2017 年 8 月 1 日起，董文卓先生正式担任公司副总经理一职。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	1,145,491.20	0.17%	1,066.83	0.17%	-
华信证券	1	7,596,407.82	1.11%	6,922.67	1.11%	-
银河证券	1	8,213,493.00	1.20%	7,649.24	1.23%	-
东兴证券	1	10,302,278.98	1.50%	9,594.42	1.54%	-
国信证券	1	14,751,950.69	2.15%	13,738.57	2.20%	-
国金证券	2	16,071,745.76	2.34%	14,646.38	2.35%	-
国泰君安	1	17,699,953.15	2.58%	16,130.00	2.59%	-
华泰证券已退租	2	9,917,631.54	1.44%	9,236.52	1.48%	-
华泰证券	1	9,868,604.28	1.44%	8,993.11	1.44%	-
中金公司	1	25,227,365.50	3.67%	22,989.35	3.69%	-
光大证券	1	25,427,876.30	3.70%	23,680.65	3.80%	-
招商证券	1	26,922,900.83	3.92%	25,073.29	4.02%	-
海通证券	1	32,570,135.62	4.74%	30,332.67	4.86%	-
广发证券	1	44,399,802.84	6.46%	41,349.89	6.63%	-
广州证券	2	44,958,797.02	6.54%	31,979.38	5.13%	-
兴业证券	1	57,855,969.90	8.42%	53,881.60	8.64%	-
申银万国	1	72,878,030.72	10.61%	66,414.22	10.65%	-
中信建投	2	261,250,673.79	38.02%	239,915.06	38.47%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期内无新增交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

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；

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；

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高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	20,000,000.00	3.16%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	3,319,966.31	35.13%	-	-	-	-
华泰证券已退租	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	114,000,000.00	18.01%	-	-
招商证券	-	-	60,000,000.00	9.48%	-	-
海通证券	-	-	13,000,000.00	2.05%	-	-
广发证券	-	-	148,400,000.00	23.45%	-	-
广州证券	-	-	39,000,000.00	6.16%	-	-
兴业证券	-	-	137,000,000.00	21.65%	-	-
申银万国	6,130,581.84	64.87%	-	-	-	-
中信建投	-	-	101,500,000.00	16.04%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期

1	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2016 年 12 月 31 日资产净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-01-03
2	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-01-23
3	光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行手机银行基金申购及定期定额投资手续费优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-02-23
4	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-03-01
5	光大保德信基金管理有限公司关于参与宣信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠活动及申购起点调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-03-16
6	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-03-28
7	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2016 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-03-28
8	光大保德信新增长混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-04-21
9	光大保德信新增长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-04-27
10	光大保德信新增长混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2017-04-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信新增长混合型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信新增长混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信新增长混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信新增长混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信新增长混合型证券投资基金法律意见书

- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、报告期内光大保德信新增长混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日