

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	(%)
1	600028	中国石化	28,944,978.52	3.19
2	600882	伊利股份	23,996,781.87	2.65
3	601066	久谦医药	17,191,301.51	1.90
4	600688	华泰证券	16,999,315.38	1.87
5	601628	中国人寿	16,940,805.17	1.87
6	600104	上汽集团	16,923,568.51	1.87
7	601601	中国太保	16,896,331.36	1.86
8	601398	工商银行	16,866,010.17	1.86
9	601939	建设银行	16,812,489.07	1.85
10	601288	农业银行	16,770,956.00	1.85
11	601857	中国石油	16,764,302.68	1.85
12	601318	中国平安	16,733,345.00	1.85
13	600276	恒顺医药	13,736,709.24	1.47
14	000539	粤电力A	12,441,610.00	1.37
15	000538	云南白药	12,147,483.50	1.34
16	000033	美的集团	12,117,582.72	1.34
17	000869	张裕A	11,900,531.00	1.31
18	000002	万科A	11,888,307.58	1.31
19	000513	山东黄金	11,876,686.73	1.31
20	002304	神韵股份	11,810,943.93	1.30

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交数量×成交价格，相关交易费用不考虑。1.1.1 累计买入金额占期末基金资产净值5%或前20名的股票明细

金融单位:人民币元			
序号	股票代码	股票名称	本期累计支出金额
			(%)
1	600887	伊利股份	23,302,647.00
2	600648	保利地产	17,030,002.00
3	600028	中国石化	16,926,219.91
4	600104	上汽集团	16,899,231.88
5	601628	中国人寿	16,676,674.87
6	601959	浦发银行	16,653,144.80
7	601657	中国铁建	16,638,052.26
8	601288	农业银行	16,275,706.09
9	601601	中国太保	16,277,796.55
10	601318	中国平安	16,762,932.00
11	601398	工商银行	16,684,503.02
12	601006	大秦铁路	16,107,521.07
13	600276	恒瑞医药	13,282,085.08
14	000538	美兰机场	11,991,284.63
15	000002	万科A	11,903,579.15
16	000513	前海人寿	11,815,885.91
17	000001	平安银行	11,815,554.41
18	000869	张 药A	11,799,406.30
19	000729	高伟明源	11,774,608.66
20	000423	中国阿拉	11,730,354.50

1.1.2 卖出股票溢价扣除卖出股票交易金额,扣除交易手续费以及成交金额,相关交易费用不予考虑。

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	493,913,984.06
卖出股票收入(成交)总额	442,519,309.22

注:表中“买入股票成本(成交)总额”及“卖出股票收入(成交)总额”均指成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

1.2 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	8,006,898.20	0.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	91,753,000.00	10.12
	其中:政策性金融债	91,753,000.00	10.12
4	企业债券	20,192,000.00	2.23
5	企业短期融资券	250,269,000.00	27.60
6	中期票据	-	-
7	可转换债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

13. 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		576,220,896.20	40.83		
		金额单位：人民币元			
序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	015114008	15年国电SCP008	800,000	79,984,000.00	8.82
2	011510030	15年石油债CP003	700,000	70,035,000.00	7.72
3	150207	15国开07	500,000	51,695,000.00	5.70
4	011519930	15年国电SCP003	500,000	50,265,000.00	5.54
5	011519969	15年国电SCP005	500,000	50,045,000.00	5.52
14. 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有资产支持证券。					
15. 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有贵金属。					
16. 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有权证。					
17. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明					
17.1 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有股指期货持仓。					
18. 本基金投资股指期货的投资政策					
本基金本报告期末无股指期货持仓。					
19. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明					
19.1 本报告期国债期货投资策略					
本基金本报告期末无国债期货持仓。					
19.2 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。

1.8.3 本期国债期货投资情况

本基金本报告期末未投资国债期货。

1.9 投资组合报告附注

1.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况：

2016年9月9日，广东证券股份有限公司中国证券监督管理委员会（调查通知书【粤证调查字20160902号】），因公司涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法事项行为，根据《中华人民共和国证券法》相关规定，中国证券监督管理委员会对公司立案调查。2016年9月10日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（中国证券[2016]171号），拟对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得60,805,135.75元，并处以15,407.25元罚款。

1.9.2 本基金管理人对上述基金的投资决策程序和符合相关法律法规和公司制度的要求。

1.9.3 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

1.9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,125,665.52
2	应收证券清算款	1,029,630.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,227,553.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	-

单位：人民币元

9	合计				6,382,789.95																				
1.0.4 期末未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。																									
1.0.5 前十大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。																									
2. 期末基金份额持有人户数及持有结构																									
<div> <div>基金份额:份</div> <table> <tr> <th rowspan="3">持有人户数 (户)</th><th rowspan="3">户均持有的基金份额</th><th colspan="4">持有人结构</th></tr> <tr> <th colspan="2">机构投资者</th><th colspan="2">个人投资者</th></tr> <tr> <th>持有份额</th><th>占份额比例</th><th>持有份额</th><th>占份额比例</th></tr> <tr> <td>312</td><td>2,890,898.92</td><td>895,627,933.09</td><td>99.08%</td><td>8,332,529.32</td><td>0.92%</td></tr> </table> </div>						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	占份额比例	持有份额	占份额比例	312	2,890,898.92	895,627,933.09	99.08%	8,332,529.32	0.92%
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	占份额比例	持有份额	占份额比例																				
312	2,890,898.92	895,627,933.09	99.08%	8,332,529.32	0.92%																				
2.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况																									
持有基金份额(占总额)		占基金份额比例		0.1723%																					
基金管理人所有从业人员持有本基金		1,585,923.82																							
2.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量的数量区间的分布情况																									
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		0																							
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																							

	单位:
基金合同生效日(2015年6月15日)基金的份额总额	209,472,365.28
本报告期末基金份额总额	
基金合同存续期间基金份额总额	1,744,826,782.15
基金合同存续期间基金份额总额占基金总资产的比例	1,052,338,825.02
基金合同生效日起至报告期末基金总资产变动额(期间减少以“-”填列)	
本报告期末基金总资产	901,960,462.41

§ 4 重大事件揭示

4.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

4.2 基金管理人、基金托管人专门(基金托管人)的重大人事变动

基金管理人发生的人事变动

(1) 2015年1月30日,2014年度股东会会议决议通过,聘任李朝晖女士、黄庆贤先生担任公司董事;选举刘卫东先生担任公司独立董事。公司于2015年2月12日向中国证券监督管理委员会备案,并获中国证监会派出机构备案无异议。

(2) 2015年4月20日14时12分,股东会2015年第二次临时会议决议通过,聘任魏德军先生、傅勇强先生担任董事;选举傅勇强先生担任公司独立董事。公司于2015年6月12日向中国证监会备案,并获中国证监会派出机构备案无异议。

(3) 2015年6月18日16时26分,股东会2015年第四次临时会议决议通过,田德军先生不再担任公司独立董事职务,聘任魏德军先生担任公司第五届董事会董事及公司第五届监事会董事;补选周川先生担任公司独立董事的职务并担任公司的监事职务。并于2015年6月12日向中国证监会备案并获中国证监会派出机构无异议。

(4) 2015年9月2日,公司发布公告,聘任魏德军女士为公司副经理。该变更事项,经通过基金管理

公司第五届董事会第一次会议审议通过,并按规定向中国证券投资基金业协会备案;

6) 2015年9月7日,经融通基金管理有限责任公司股东会2015年第五次临时会议审议通过,聘任刘宇先为公司监事,并聘任刘宇先为融通基金管理有限责任公司副总经理;

(2) 本报告期基金托管人的专项(基金托管部)内重大人事变动情况

本报告期基金托管人的专项(基金托管部)无重大人事变动。

4.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期,无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

4.4 基金投资范围的改变

本报告期内,本基金投资范围未发生改变。

4.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),本年度应支付的审计费人民币70,000.00元。

4.6 管理人、托管人及高级管理人员受行政处罚等情况

本报告期内,本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情

4.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

4.7.1 基金租用证券公司交易单元用于证券投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券及权证交易		备注
		成交金额	占当期股票成交比例	成交金额	占当期债券成交比例	
中信建投	2	935,404,594.07	100.00%	830,562.27	100.00%	-

注1、本基金选择租用本公司券商的基金证券经纪业务类券商的证券经纪机构的标准包括以下六个方面: 1、综合实力; 2、信誉良好; 3、注册资本; 4、财务状况; 5、经营业绩; 6、研究水平。

2) 财务状况良好,各项财务指标符合公司经营状况规定;

3) 经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国银监会处罚;

4) 内部管理制度严格,具备健全的内控制度,并满足基金运作安全保密的要求;

5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合证券交易的需要,并具备基金运作所需的其他条件;

6) 经研究分析,有固定的研究机构分析,并能及时为本基金提供高质量的咨询服务,包括经济公告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告,并能根据基金投资的特定要求专门研究投资;

2. 选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经纪机构的程序包括以下四个步骤:

- 1) 券商资格评价;
- 2) 拟定拟用对象。由研究部根据以上评价标准拟定备选券商;
- 3) 上报批准。上报评价报告并经基金经理审批;
- 4) 签约。在获得批准后,按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3. 交易单元交易佣金按本报告期内:

4.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	398,534,803.91	100.00%	1,765,000,000.00	100.00%

二〇一六年三月三十日