息披露方式

阶段

## 基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司 基金托管人:中国银河证券股份有限公司 送出日期:2016年3月28日 § 1 重要提示及目录

华度报告已经全体收立董等学习题。并由董事长签发。 现是杂种情况是小园根本基金合同股份。于2010年3月至50里钱产本报告中的财务指标。净值表现。利朗分配 创金报告等的等。杨证复独内容不存在想见战,因学时除这或者取大遗漏。 农农信用,杨起度对那到摩阳周阳周星旁产,但不停延达金一定割, 代代表其未来现。 投资有熔点,投资者作中出投资成期加行和阅读本基金的招募识明书及其理师。 1年度报告还之,投资者仅需率和特全。

基合物用人的董事令、董事保证本报告所被资料不存在建筑过载,民時性除证或重大资源,并对 明及基础设计算机。 在单级接出已经全体接收董事等学师员,并由董师长等校 基合作能人中部则证券提供的价格,则是基本的专用的基本基合与由于基本的工程。 ,对今公计报告,现货出合程合物内容,保证基本的资本存在建筑之载。 医特殊法式者用比妥协 基金管理人来说过这些明,最级更多的资源的原理和国际直接设施,但是特殊的发生比较 基金管理人来说过这些明,就是是"特别的原理和国际直接设施",但不是任意一个批判 基金管理人来说过这些明显,就是"是有限"。 现象有限。 把要者在作出现货币等则进行相同该本 本年度和任务需要拥有中度报合工文,是现象的广播中等,是可以对自己社

上市日期 基金产品说明 在有效控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,并通过精选一带 - 路主题的相关上市公司股票进行投资,力争基金资产的持续隐址增值。 设资目标

U险收益特征 基金管理人和基金托管

3.1 主要会计数据和财务指标 期末基金资产净值 国非基金仲認學但 注:1、北周已並制度越積極企業得利息收入,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)和除相关费用高的余额。本期利何为本地 现收益加上本明公允价值变动收益。 2、水周水可供分配利润,采用期末款率分配利润与未分配利润中已公规部分的物底数(为期末余额、不是当期发生数)。 3、以上市还基金进制指示不起的有名人从购成交易基金的各项费用(特如基金申购集回费、基金种费费等),许人费用后运车利润。

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 收益率标准差 多屬蓋率,抗機似性域。并且有较高的知名或實用等影响力,中極原金指數由中心思播使上地質有限混在公司論則,并未僅多 這個,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场。不同及行主体和即限,能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动域 更基金資产低溫与市场指数代表性等因素,本基金选用产环200指数和中债综合指数加度作为本基金的投资业制产的基础。

(I)-(3)

2-4



注:本基金合同于2015年4月10日生效,合同生效当年按实际存號期计算,不按整个自然年度进行折 3.3 过去三年基金的利润分配钠码 本基金基金合同生效日为2015年4月10日,基金合同生效日至报告期期末,本基金未进行利润分配。 5.4 管理人报告 = Zera-IPA . . . . . . . . . . . . . . . . . .

\$4 管理人报告
41. 基金管理人及基金影用情况
41.1 基金管理人及其管理基金的经验
随即股端联基金管理有限公司,原中最基金管理有限公司,经中国证券监管管理委员会批准,于2002年6月13日正式成
注册费本亿元人取币,公司是中国第一家外方持股比例达到40%的合营基金管理公司、公司股东实证股本撤销托有限公司(国家开 设役公司的股股子公司)及取出货用处有限公司(US AG)、公司利有汽港的法人治理转由,建立了有效的股合管理及处理外 现代。创新、包字、等于关注中为公司的企业文化。截止2015年12月底、公司有员工207人,其中118人具有硕士或博士学位;公司管理 提卷。其中但及706需型分级基金

姓名 职务 任职日期 离任日期 中国籍。博士。曾任上海市发改委综合经 行研究所助理研究员,万家基金管理有限公司研究员,华泰帕瑞基金管理有限公司 下发员。2012年6月加入国投聯银。 完 投聯银新丝路灵活配置混合型证券投 基金基金

3440000 2015年4月10日

以天规定。 4. 管理人对报告期内本基金运作遵规宁信情范的说明 在报告期内,本基金管理人进守(证券投资基金法)及其系列法规和(国投资报新丝路及恶配置混合型证券投资基金基金合同)等有 这、本营格?现在,课报题题,出交采到的原则,涉查合物顺有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内,基金的投资决策规范, 运动作会给全规,没有预度基金分额持有人利益的行为。 4. 管理人对报告期次公平交易领征的专项规则

理机人对格尔朗内公平交易物的凸钉空项应则 公平交易制度取得的方法 (水原证富含(证界投资基金管理小司公平交易制度指导意见)的要求,制定了公平交易管理相关的(公平交易管理规定),(交 法,(异常交易管理规定)等系列制度,并建议和完善了相应的控制措施市业务被程。

理助法》、《异常交易管理规定》等系列制度,并建立和完善了相应的控制指 管理人公平交易管理坚持以下原则: 1.当管理人利益和基金持有人利益发生冲突时,坚持基金持有人利益优先; 2.当不同资产委托人利益发生冲突时,应公平的对待不同的资产委托人;

3、公平对待管理人旗下管理的不同投资组合; 4.严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送

符念平支施环编。 2、公平支原的范围覆盖所有投资品种,以及一级市场申购;二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动,同时涵盖研究分析,授权《投资决策、文易执行、业部评估等投资管理活动相关的参与本作。 3、合理设置条资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构,在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,确保其 在採用投资信息,投资建议报览施投资决策方。而单分《平价和资本 4、建立任学的投资选择条系,就完定制力是约尔德尔纳。通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现,同时通过监察 4、建立任学的投资选择条系,就完定制力能约尔德尔纳。通过严格的制度、流程、技术手段等保证公平交易原则的实现,同时通过监察

縣。斯斯汀村於民島級蔣承瓜18892年一大的1938年8 管理人有关交叉。最初的方式的要点如下。 1.以系统國制控制分批先指揮。公司通出不断光路投资决算、研究支持、交易执行相关的信息管理系统,充分发挥系统的自动控制功 1.以系统國制控制分批先指揮。公司通出不断光路投资决策,研究支持、交易执行相关的信息管理系统,充分发挥系统的自动控制功 ,保持公平交易管理的变换。在系统中让资料的企业,在第一个交易条件的不可设度组合的同立实指令在交易系统中编制来用公平交 5.学校的情趣成对特定业务自动执行必要的连续流程。如:符合交易条件的不可设度组合的同立实指令在交易系统中编制来用公平交 5.分析进行交易,仍需要对设备全部对系统中一级发布含自动加充到特殊金统里,或使现代。然间和国际转效必须应监督被临随过系

(3)的能用方公果,内障研究机能在研究系统中一些发布会自动用处型内内器重应性。以来可能,这种证明。 这样有效排产。由两种生产的一种生产。 2、2、2次人复核,集体决策为控制的制度,是一位分别计控制率或签署使用于强制控制的业务活动,通过建立界确定业务规则和高程,在关键 2、2、2次双人复核,集体决策分配制机制,通过分别对控制率或签署使用于强制的电动,这类对关键业务风险的管理。如:以公司 可以公司,这些行动一类的影响的指张分配,需要经过严格的公平性业核,由交易能负重人,直等和能够改变人以及使现任合金型 证明确认对分配结果公别认许签署后才为有效。

可耐人对分配线果无对以开答案用:了为有效。 3.以日常监控为曾使手段。公司交易感。监察植核郎。运营部设置专门岗位,分别在交易过程中、日中、消算后对有关公平交易规则的 行物品进行强化,并按照定的报告要及及时揭示过反规定的情况。监督都使公平交易制度的执行。如:交易部对相同战党经营管理不同 政组合指令时间是的监查。据察相核原对日中、印阻在全发制而识虑的价是分析以及监营部对银行间制令要素和签考情态形态也多。 4.以早后专项相称表现定例今平26分中方完善措施。用部址十专负点两个证明公全的是个交平交易的情况还并专项情能。据解核 分别于每季度和每年度对公司管理的不同政党组合的整体收益基础是分分投资别(股票、债券)的收益基础是并行分所,对连续四个 按照向人、不同时领官下,仅由内、公司人。5日公司管理的不同政党自由党系的交易进行分析。对连续四个 较期间人、不同时领官下,仅由内、公司人。5日公司管理的不同政党自由党系的交易进行分析。对生后的专项精致的 分析,发现控制薄弱环节或交易价差异常,将组新核查公司投资决策和交易执行可能见制,并对着在问题完善公平交易制度和流

公平交易和印度無限51分,可形成67%和15年,自2000年 422 公平交易加度的共作情况 本报告期内,管理人通过制度,然程和技术手段保证了公平交易原则的实现,确保本基金管理人版下各投资组合在研究,决算、交易从 李核方面均剩6次平均待,通过对投党交易行分的范围。分析评估和信息被露来加强对公平交易过程和结果的适合,形成了有效地公平 磅条系,本格台期,本基金管理人各现公平交易则能度都是均到到线产地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的现象。 松台期内,信息工产每季度和年度处合管理部外不同使组合合整体使业器差别,分投资别,即复,债券可收益基础等进行分析, 建建四个季度期间内,不同时间窗下(如白内,3日内,5日内)公司管理的不同投资组合管内区易的交易价差进行分析。 条单度 "从本生化从2006年成为16年"

差专奶分析的情况如下: 1. 管理人对两人使我自合过去连续四个季度内间向交易相同证券的交易价差的强价率进行分析,对两两组合间向交易成交价格均 强价率最后基础于零进行"检验。检验在59%和可信从平下,价格均值的磁价率超近于零是否存在他由不通过的特况。 2. 管理人对两个规划信任过去进程则不零度对同时变相同证券的交易所念优先进行比较、区分定成。该次、次、次次等情况分 析两规组合在即间内交易的提告存任证据常化了另一方的罗常情况。 3. 管理人对两个规划组合在过去途取价平衡度时间可变制而证券的交易价差区分两两组合进行和越输送的模拟测算。检查在过去

3、15国人分所有较更值1户在过去定域的下学度从同时交易时间此类的28时在成立为种种组立进了构建超过的构成问题,但这在立立等模式,是否作品类型形式的形成。 种类分析结果显示。《中国理想所有投资组合,在过去连续四个季度内未发现存在进反公平交易原则的情况。 4.4.2 研究是用于动物。使现的 4.4.2 研究是用于动物。使现的 基础管理,从管理的所有投资组合在本报色期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成文较少的单边交易量超过该证券当日总 需要以完全部的所有投资组合在本报色期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成文较少的单边交易量超过该证券当日总

关工件经历。 未基金的口带价值程序由运营哪基金估值核简及执行。运营部内部复核价值结果,并与托管银行的价值结果核对一致。基金估值政策的以定和修改采用集体讨论机制,基金经理作为估值小组成员,对本基金特仓证券的交易情况。信息披露情况保持应有的职业报惠,向信息小组提供估值参考信息。参与估值政策讨论。对需采用特别信值程序的证券,基金管理人及时后动特别估值程序,由信值小组讨论议定特别估值发生,并比较行动通点。上提合被与规矩即要及合体以后由运营部及执行中,

## 国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金 LOF)

5.1 报告期内本基金托管人遗规宁恰镇风声明 本报告期内。中国强同证券股份有限公司在本基金的托管近极中,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、不存在任何的继接金份额进行人利益的行为、党全是限灵势地理厅了基金托管人及足的义务。 5.2 托管人对报党期内本基金投资运市建筑宁信,净值计算、利润分配等确定的说明。 4.程管则对,未任管人规则证券投资基金为及其他定注法规据金合同、托营协议的有关规定、对本基金的基金资产净值计算。基金费用于支等方面进行了认真的复数。对表基金的设计运作方面进行了监督。未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。 5.3 托管人对本证理报告中等价信息等均容的实实,海南研究整处表现。 本托管人依法复额现役强根基金管理有限公司编制和股票的国投资指数经路运死配置混合管证券投资基金(LOF)2015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、投资组合报告等均等。以上内容真实、准确和完整。 6 审计报告 5 审计报告

§7 年度财务报表 7.1 资产负债表 会计主体:国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 报告截止日:2015年12月31日

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
资产:		
银行存款		268,071,201
结算备付金		908,826
存出保证金		1,015,673
交易性金融资产		207,834,694
其中:股票投资		207,834,694
基金投资		
债券投资		
资产支持证券投资		
贵金属投资		
衍生金融资产		
买人返售金融资产		
应收证券清算款		4,746,626
应收利息		118,053
应收股利		
应收申购款		235,896
递延所得税资产		
其他资产		
资产总计		482,930,962
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负债:		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		
应付证券清算款		4,793,144
应付赎回款		1,861,793
应付管理人报酬		628,887
应付托管费		104,814
应付销售服务费		
应付交易费用		670,650
应交税费		
应付利息.		
应付利润		
逆延所得税负债		
其他负债		149,925
负债合计		8,209,216
所有者权益:		
实收基金		385,117,249
未分配利润		89,604,497
所有者权益合计		474,721,746
负债和所有者权益总计		482,930,962

连:(1)報告截止日2016年12月3日,基金份額净值人民币1233元,基金份額戶額385,117,249,39份。 (2)本基金6世生效日29,016年4月10日。2016年度实际报告期间为2016年4月10日至2015年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未漏一生。未报告期的身根表及根表附注均无同期对比数据。

72 利润表 会计主体:国投瑞银新丝路灵活配置混合型证券投资基金(LOF) 本报告期:2015年4月10日至2015年12月31日

资 产	附注号	本期 2015年4月10日至2015年12月31日
一、收人		120,619,424.29
1.利息收入		2,761,968.07
其中:存款利息收入		2,761,968.07
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买人返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2投资收益(损失以"-"填列)		102,787,204.48
其中:股票投资收益		100,179,842.37
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		2,607,36211
3.公允价值变动收益(损失以 "-" 号填列)		9,685,20255
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		5,385,059.19
减:二、费用		14,663,797.70
1. 管理人报酬		7,399,902.01
2. 托管费		1,233,317.09
3. 销售服务费		-
<ol> <li>交易费用</li> </ol>		5,809,578.60
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用		221,000.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		105,965,626.69
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		105,965,626.59

項目	本期 2015年4月10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)	952,670,970.41	-	952,670,970.41			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期 利润)	-	105,955,626.59	105,955,626.59			
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)	-567,563,721.02	-16,351,129.56	-583,904,850.58			
其中:1基金申购款	545,881,616.10	52,467,657.36	598,349,273.46			
2基金赎回款	-1,113,435,337.12	-68,818,786.92	-1,182,254,124.04			
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)	385,117,249.39	89,604,497.03	474,721,746.42			
时注为财务报表的组成部分。 是57.1至7.4财务报表由下列负责人签署:						
T#	77.444	STT 664				

三杉 主管会计工作负责人 二 

本功劳很表明和-练星打到福田市-EL-NELZAMINGAR ER ER ET THE ART THE A

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度 本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年4月10日(基金合同生效日)至2015年12月

(1)金融资产的分类 金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投 金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能压力。本基金驱无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投

本基金目前以交易目的持有的股票股密分类为以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值 计人损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产则示。 本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在还跃市场中设有限价、回收金 定成项制度的非常企金融资产。

邓丁4公允尔德甘中国 其现空时人 当期局益的金融资产,按照公允价值进行后续计量,对于应收款项和其他金融负债采用实际利率 现金成是对于高线计量。 金融资产海风下等场件之一份,不以终止确认(1) 使仅该金融资产现金成组的合同权利修上。(2) 该金融资产已转移。I. 日 基本综合 华所有权区,几乎有有的风险规程服务经验负责。(3) 该金融资产已转移。I 虽然 基金联设有转移也没有保留金融资产所有权上 研有贸易和限制。I. 日底按下了核金融资产作划。 金融资产等上编机。其集而价值与收到的对价的资源,I. 人当期损益。 当金融价值的即时又多全部逐渐分已经解除时,核止确认该金融负债或又多已解除的部分。核止确认那分的账面价值与支付的对价 ID类据,I. 人等限损益。

維假设如下: 对于班券交易所上市的股票,若出现重大事項除牌或交易不活跃(包括能跌停用的交易不活跃)等情况。本基金根据中国证监会公告 6188号(关于进一步规范证券投资基金给值业务的指导意见),根据具体情况采用(关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数 知 ) 基供的销载收益法等给值技术进行估值。 74.5 会计投资和会计估计变更以及差销更正的说明

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差 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

关联方名称

本基金本报告期未发生会计估计变更,
74.5.3 差错更正的说明
本基金在水极告期间永远德明的会计差错更正。
74.5.3 差错更正的说明
本基金在水极告期间永远德明的会计差错更正。
74.6.8 彰明
根据附级部 国家教务总局财献2002[128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若 根据附级部。国家教务总局财献2002[128号《关于开放工证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2018]1号《关于企业所得税若 战级政策的通知》、财税[2012]128号《关于实施上市公司股息红利差别位个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上 公司股后复元方基料资金本报与全量处理的规划,是权益相关财权法规则及务操作。主要规则示如下。
(2) 对基金方式方式募集资金本用产量业股积收减期,不收置金型规、基金实发票。债券的差价收入不产业改营业税。
(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,股权的股息《红利收入、债券的利息收入及其他收入、都不证收业所得点。

股所得别。
(2) 對基金取得的企业债券和自收人。应由发行债券的企业在构基金支付和自时代记代第20%的个人所得职。对基金从上市公司取价即已经订销所得,特别期限在小个日以内含小个月的。其就是红利斯得多。特别期限在小个日以内含小个月的。其就是红利斯得多。特别期限在小个日以上至当年会占申的。 被控约56%计入边域的所得解。持期期限在小个日以内含小个月的。其就是红利斯得多面扑上边缘积所得。这一种原理在小个月以上至年间会自由的。我在公司人 作用税,对基金持有的上市公司周性税,解除国际制度组(在外域)人被国上总规定计划的规则,是现时间目解禁日起计算,解禁前取得 见息。红利收入继续智道被收50%计入边缘积所得能。上述所得统一通用20%的影率计证个人所得税。

7.4.8.1.2 应支付关联方面 金额单位: 2015年4月10日至2 期末应付佣金余额

注:1. 上述佣金参考市场价格经本 手费的净额列示。权证交易不计佣金。 2. 该类佣金协议的服务范围还包 74.8.2 关联方报酬 74.8.2.1 基金管理费 內本基金的基金管理人与

2015年4月10日至2015年12月31日 注:支付基金管理人的管理人机器使第一日基金资产等值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付日管理人机器 — 前一日基金资产等值 X 1.50% / 当年天数74.822 基金托管费

項目 2016年4月10日至2015年12月31日 劃度生的基金应支付的托管费 1,223,317, 注:沒付基金托管人的托管费按的一日基金资产净值0.25%的年费率计划,逐日累计至每月月底,授月支付。其计算公式为 日托管费。前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天教。 74.83 与某政于指任标间间电池部的债务会自则为交易。 术基金本根分期间未通过文联方进于保行间间电冲场的债务(回购)交易。 74.84 名英政产投资本基金的情况。 74.84 名英政产投资本基金的情况。 74.84 名英政产投资本基金的情况。 74.84.2 保管期未验基金管理人运用国有资金投资本基金。 74.84.2 保管期未验基金管理人运用国有资金投资本基金的情况。 74.84.2 保管期未验基金管理人之外的其他实现方投资本基金的情况。 74.84.2 保管期未验基金管理人之外的其他实现方投资本基金的情况。 74.84.2 保管期未验基金管理人之外的其他实现方投资本基金的情况。 74.84.2 保管理人交给的其他实现方投资本基金的情况。 74.84.2 保管理人交给的其他实现方投资本基金的情况。

数量 8000 マルオ 证券 名称

E:国泰君安证券股份有限公司首次公开发 图明,本基金按照法律法规要求履行相关审

可流通 日 流通受限类型 认购 柳末估值单价 (单位: 股) 证券 名称

7.4.9.2	2 期末持4	<b>与的暂时</b>	<b>P牌等流通受限</b>	股票					金額	单位:人民币元
股票代码	股票名称	停牌日 期	停牌艇因	期末 佔值单价	短牌日 期	复牌 开盘单价	数量 (单位: 股)	期末 成本总額	期末 估值总额	
600771	广誉远	2015-11 -16	重大事项停牌	32.97	2016-03 -09	28.78	1,436, 153	46,368, 413.98	47,349, 964.41	7.4.9.3 期末债
券正回购交易中作为抵押的债券										

7.4.9.1 银行间市场储费证回购 本基金末格包啡未补特银行间市场债券正回购交易中作为批判的债券。 7.4.9.2 交易所市场债券正回购 本基金末格包啡未未持有交易所市场债券正回购交易中作为批判的债券。 7.4.1.0 年的于规解和分析会计报表需要说明的其他事项 (20分金价值

た。 ☆非持续的以公允价值计量的金融工具 于2015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。

于2015年12月31日。本基金科學刊申刊等6月25年27年18年12日 6中以及分价的值計館的金融工具 不以分允价值计值的金融资产和负债主要包括政政款項用其他金融负债,其账间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。 5.8 投资组合报告

农、林、牧、渔业 批发和零售业 交通运输、仓储和邮政业

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	600771	广誉远	1,436,153	47,349,964.41	9.97
2	000538	云南白药	421,963	30,642,953.06	6.48
3	000590	*ST古汉	892,592	23,127,058.72	4.85
4	600536	中国软件	510,892	18,432,983.36	3.88
5	600416	湘电股份	762,698	15,810,729.54	3.33
6	000423	东阿阿胶	291,082	15,223,588.60	3.21
7	600038	中直股份	277,890	14,653,139.70	3.09
8	600410	华胜天成	543,614	14,411,207.14	3.04
9	002013	中航机电	554,092	12,555,724.72	2.64
10	000858	五粮液	371,905	10,145,568.40	2.14

				金額单位:
序号	股票代码	股票名称	本期累计买人金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000423	东阿阿胶	68,085,285.13	14.30
2	000801	四川九洲	65,119,449.76	13.72
3	000538	云南白药	60,913,449.47	12.83
4	600771	广誉远	51,532,922.19	10.86
5	002381	双箭股份	46,966,660.04	9.89
6	600410	华胜天成	45,791,185.12	9.6
7	600038	中直股份	44,787,829.43	9.43
8	002410	广联达	44,438,779.70	9.36
9	601965	中国汽研	42,279,578.96	8.91
10	000780	平庄能源	33,783,335.93	7.12
11	300345	红宇新材	33,410,555.35	7.0
12	600207	安彩高科	31,148,266.90	6.5
13	600510	黑牡丹	30,812,424.35	6.4
14	601717	郑煤机	30,172,377.69	6.3
15	600657	信达地产	29,620,367.87	6.24
16	600322	天房发展	26,324,844.10	5.58
17	000809	铁岭新城	25,702,470.56	5.4
18	002574	明牌珠宝	25,560,610.26	5.38
19	000858	五粮液	25,527,449.22	5.3
20	600159	大龙地产	25,417,536.75	5.3
21	601318	中国平安	25,185,753.60	5.3
22	002291	星期六	24,616,979.73	5.11
23	300139	晓程科技	24,591,114.00	5.13
24	600325	华发股份	24,523,686.75	5.1
25	600641	万业企业	24,482,261.38	5.10
26	600372	中航电子	24,399,389.00	5.1
27	000736	中房地产	24,046,480.55	5.0
28	300193	佳士科技	24,011,489.26	5.0
29	002029	七匹狼	23,624,828.93	4.9
30	000157	中联重科	23,530,466.04	4.9
31	000926	福星股份	23,433,148.56	4.90

300154

进出股票的收入(成交)总额 注:"买入股票成本"、"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 85 期未按债券品种分类的债券投资租合 本基金本报告期末未持有债券。 3.6 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

,报告周末本基金投资的国境附加文系则命心识别 13. 本期国德刚更投资政策 59.地京规股资目标,本基金在注阻风险管制的前提下,以套期隔值为目的,通度运用国德刚货等金融衍生品。本基金利用金融估额治理长、妥良市本纸和工程操作等等点。提高投资组合的选作效率。

品。例外以及光记制末未持有债券。 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细本基金本期末未持有资产支持证券。

本產並本稅官房未完建訂這即時以仅以 8.12 投資盈色等的排注 8.12.1 未結金投資的前十名证券的效行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制目前一年内未受到公开谴责、处罚。 8.12.2 基金投资的前十名证券的效行主体本期没有被监管部门立案调查的,在报告编制目前一年内未受到公开谴责、处罚。 8.12.2 国来其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有处于转股期的可 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限制

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.2 期末上市基金前十名持有人

		(j=1)	10 117 (1.10)		14 13 10 161 ( 10 7	ELECTRICAL DIRECTOR	
		1	王克俭		6,220,000.00		9.05%
		2	中国宋庆龄基金会		5,002,021.00		7.28%
		3 薛晓娟			1,004,696.00		1.46%
		4 伍利玲			1,000,194.00	1.46	1.46%
		5	巍娜		968,765.00		1.41%
		6	侯芙菊		630,036.00		0.92%
		7	桂梅		600,099.00		D.87%
		8	林观元		600,092.00		D.87%
		9	吴书文		600,000.00		0.87%
		10	林品光		570,132.00		0.83%
			息由中国证券登记结算有限责任公司 E人的从业人员持有本基金的情况	提供	ŧ.		
			項目	Т	持有份额总数(份)	占基金总份额比例	
			管理人所有从业人员持有本基金	Т	564,633.24		0.15%
	9.4	期末基金管理	E人的从业人员持有本开放式基金份8	iii.	量区间情况		

11.1 基金份额持有人大会决议

·副忌羟埋。 8理 . 王彬女七接任管理人总经理;包爱丽女士自2016年2月3日起不再任管理人 副总经理。 昭告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

报告期内无限及水基给取进风心,如此小 1.4 基金投资解除改变 报告期内基金合同性效,基金投资钢炼未发生变化。 11.5 为基金进行时付金计师事务所情况 报告期内本基金合同生效,初次聘请替华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务。报告期内应支付恰该事务所的报酬为80 报告期内本基金合同生效,初次聘请替华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务。报告期内应支付恰该事务所的报酬为80

200元。 116 管理人,托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 报告期诉基金管理人,基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。 117 基金租用证券公司交易等元的有关情况 1171 基金租用证券公司交易等元进行股票投资及佣金支付情况

成交金额

佣金