

## 2016年年度报告摘要

本期净利润(转出)第二层次的成本金额为零元,计入损益的第三层次金融工具公允价值变动金额为零元,涉及云沃森生物技术股份有限公司发行的股票(2015年度:0元)。(6)非持续的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)。(7)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抵较小。(除公允价值相抵外,截至资产负债表日本基金无需说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	1,070,130,466.02	76.43
2	固定收益	1,070,130,466.02	76.43
3	银行存款	119,502,000.00	8.47
4	企业债	—	—
5	可转债	—	—
6	其他资产	119,502,000.00	8.47
7	合计	119,502,000.00	8.47

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权益投资明细

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	010846	国开债16	1,200,000	119,502,000.00	8.47

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

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

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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内前十名证券的发行主体本期未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、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,886,131.00
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	1,142,309.19
4	应收股利	344,306.61
5	其他应收款	—
6	其他资产	—
7	合计	3,370,746.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限原因
1	000078	东方电气	113,381,884.00	4.48	重大资产重组

9.1 期末基金的投资人人数及持有人信息

序号	投资人类型	投资人数量	持有基金份额占基金份额总额比例(%)
1	机构投资者	113,381,884.00	4.48

9.2 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.3 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.4 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.5 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.6 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.7 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.8 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.9 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.10 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.11 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.12 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.13 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.14 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.15 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.16 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.17 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.18 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.19 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.20 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.21 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.22 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.23 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.24 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.25 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.26 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.27 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.28 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.29 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.30 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.31 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.32 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.33 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.34 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.35 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.36 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.37 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.38 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.39 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.40 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.41 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.42 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.43 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.44 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.45 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.46 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.47 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.48 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.49 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.50 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.51 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.52 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.53 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.54 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.55 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.56 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.57 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.58 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.59 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.60 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.61 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035

9.62 期末基金管理人从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(股)	占基金总份额比例(%)
基金管理人从业人员持有本基金	889,724.00	0.0035