# 国泰成长优选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：国泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2017 年 3 月 24 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。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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 | 国泰成长优选混合 |
| 基金主代码 | 020026 |
| 交易代码 | 020026 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012 年 3 月 20 日 |
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 |
| 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 | 154,425,176.23 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过精选具有较高成长性和良好基本面的优质企业，结合估值因素对投资组合进行积极管理。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 1.大类资产配置<br>本基金运用基金管理人的资产配置评估模型（Melva），通过宏观经济、企业盈利、流动性、估值和行政干预等相关因素的分析判断，采用评分方法确定大类资产配置比例。<br>2.股票投资策略<br>本基金采用积极主动的投资管理策略，通过以下几个方面优选成长型股票：（1）企业经营方面，关注收入和利润的快速成长性；（2）通过调研分析了解财务数据背后成长的原因，并探寻成长的持续性，选择有核心竞争力的成长企业；（3）看重估值偏低的股票，寻找估值与成长性相匹配的标的，从而得到安全边际。在综合考虑投资组合的风险和收益的前提下，完成本基金投资组合的构建。<br>3.债券投资策略 |

| | |
|---|---|
| | 本基金的债券资产投资主要以长期利率趋势分析为基础，结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析，通过收益率曲线配置等方法，实施积极的债券投资管理。<br>4.权证投资策略<br>本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下稳健的超额收益。权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。<br>5．股指期货投资策略<br>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%＋中证综合债券指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。 |

## 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 | | 国泰基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李永梅 | 张燕 |
| | 联系电话 | 021-31081600转 | 0755-83199084 |
| | 电子邮箱 | xinxipilu@gtfund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | （021）31089000，400-888-8688 | 95555 |
| 传真 | | 021-31081800 | 0755-83195201 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告摘要的管理人互联 | http://www.gtfund.com |

| | |
|---|---|
| 网网址 | |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层 |

## §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 | 12,845,602.61 | 53,770,957.73 | 27,556,255.83 |
| 本期利润 | 3,704,447.30 | 48,806,897.46 | 33,328,533.22 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0417 | 0.8198 | 0.4488 |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.17% | 46.09% | 39.57% |
| **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 | 1.4082 | 1.2860 | 0.5452 |
| 期末基金资产净值 | 401,267,041.51 | 112,748,753.11 | 126,968,872.90 |
| 期末基金份额净值 | 2.598 | 2.447 | 1.675 |

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。

### 3.2 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 | -2.48% | 0.76% | 1.13% | 0.58% | -3.61% | 0.18% |
| 过去六个月 | 12.08% | 0.83% | 4.11% | 0.61% | 7.97% | 0.22% |
| 过去一年 | 6.17% | 1.75% | -8.39% | 1.12% | 14.56% | 0.63% |
| 过去三年 | 116.49% | 2.09% | 40.23% | 1.43% | 76.26% | 0.66% |
| 自基金合同生效起至今 | 164.55% | 1.83% | 28.68% | 1.30% | 135.87% | 0.53% |

### 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

国泰成长优选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

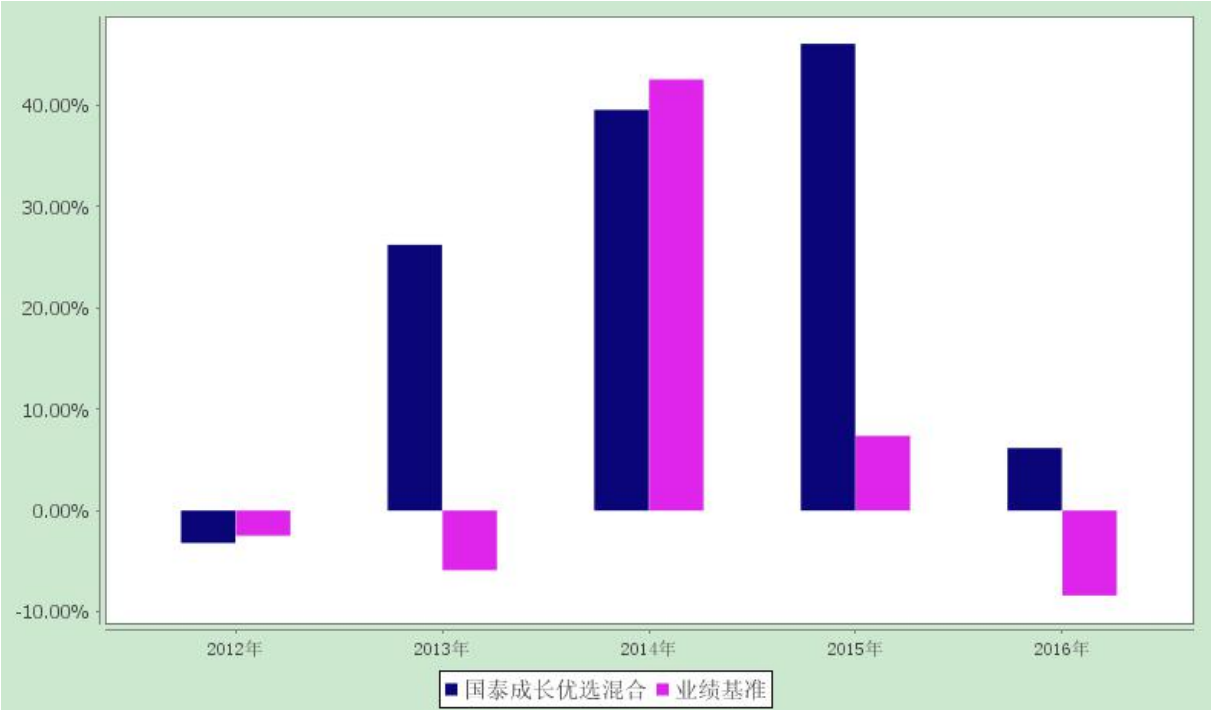
(2012 年 3 月 20 日至 2016 年 12 月 31 日)

注：本基金合同生效日为 2012 年 3 月 20 日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

国泰成长优选混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图




注：（1）2012 年计算期间为本基金的合同生效日 2012 年 3 月 20 日至 2012 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算；

（2）本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

### 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 | - | - | - | - | - |
| 2015 年 | - | - | - | - | - |
| 2014 年 | 0.223 | 696,427.74 | 252,234.19 | 948,661.93 | - |
| 合计 | 0.223 | 696,427.74 | 252,234.19 | 948,661.93 | - |

## §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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 78 只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长混合型证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括 2 只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长混合型证券投资基金、国泰沪深 300 指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势混合型证券投资基金、国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克 100 指数证券投资基金、国泰价值经典混合型证券投资基金（LOF）、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰保本混合型证券投资基金、国泰事件驱动策略混合型证券投资基金、国泰信用互利分级债券型证券投资基金、国泰成长优选混合型证券投资基金、国泰大宗商品配置证券投资基金(LOF)、国泰信用债券型证券投资基金、国泰现金管理货币市场基金、国泰金泰平衡混合型证券投资基金（由金泰证券投资基金转型而来）、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰国证房地产行业指数分级证券投资基金、国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（由国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金封闭期届满转换而来）、上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 5 年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金、国泰美国房地产开发股票型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、国泰淘金互联网债券型证券投资基金、国泰聚信价值优势灵活配置混合型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金、国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金、国泰金鑫股票型证券投资基金（由金鑫证券投资基金转型而来）、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、国泰创利债券型证券投资基金（由国泰 6 个月短期理财债券型证券投资基金转型而来）、国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金（由国泰目标收益保本混合型证券投资基金转型而来）、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金、国泰国证有色金属行业指数分级证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金、国泰生益灵活配置混合型证券投资基金、国泰互联网+股票型证券投资基金、国泰央企改革股票型证券投资基金、国泰新目标收益保本混合型证券投资基金、国泰全球绝对收益型基金优选证券投资基金、国泰鑫保本混合型证券投资基金、国泰大健康股票型证券投资基金、国泰民福保本混合型证券投资基金、国泰黄金交易型开放式证券投资基金联

接基金、国泰融丰定增灵活配置混合型证券投资基金、国泰国证新能源汽车指数证券投资基金（LOF）（由国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金转型而来，国泰国证新能源汽车指数分级证券投资基金由中小板 300 成长交易型开放式指数证券投资基金转型而来）、国泰民利保本混合型证券投资基金、国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金、国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、国泰添益灵活配置混合型证券投资基金、国泰福益灵活配置混合型证券投资基金、国泰创业板指数证券投资基金（LOF）、国泰鸿益灵活配置混合型证券投资基金、国泰景益灵活配置混合型证券投资基金、国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金、国泰丰益灵活配置混合型证券投资基金、国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金、国泰信益灵活配置混合型证券投资基金、国泰利是宝货币市场基金、国泰安益灵活配置混合型证券投资基金、国泰普益灵活配置混合型证券投资基金、国泰民惠收益定期开放债券型证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

**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 | | |
| 申坤 | 本基金的基金经理、国泰金鑫股票的基金经理 | 2015-06-04 | - | 7 年 | 硕士研究生。2010 年 4 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2015 年 6 月起任国泰成长优选混合型证券投资基金（原国泰成长优选股票型证券投资基金）的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰金鑫股票型证券投资基金的基金经理。 |
| 杨飞 | 本基金的基金经理 | 2015-05-11 | 2016-05-25 | 9 年 | 硕士研究生。2008 年 7 月至 2009 年 8 月在诺德基金管理有限公司任助理研究员，2009 年 9 月至 2011 年 2 月在景顺长城基金管理有限公司任研究员。2011 年 2 月加入国泰基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理。2014 年 10 月起任国泰金龙行业精选证券投资基金的基金经理，2015 年 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 3 月起兼任国泰估值优势混合型证券投资基金（LOF）（原国泰估值优势股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015 年 5 月起兼任国泰中小盘成长混合型证券投资基金（LOF）（原国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF））的基金经理，2015 年 5 月至 2016 年 5 月任国泰成长优选混合型证券投资基金（原国泰成长优选股票型证券投资基金）的基金经理，2016 年 2 月起兼任国泰大健康股票型证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰金马稳健回报证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰景气行业灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况的说明**

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

**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**

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、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，旨在规范交易行为，

严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数≥30），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的

基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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

2016 年沪深 300 指数下跌 11.28%，创业板指数下跌 27.71%。英国脱欧公投和美国大选等政治层面的不确定性导致全球经济形势动荡。国内宏观经济增长平稳，微观层面自三季度开始有所改善，供给侧改革在多个领域初见成效。A 股市场经历了年初的大幅下跌后，维持窄幅震荡行情。行业表现方面，食品饮料、建筑材料涨幅居前，传媒、计算机等跌幅较大。

从本基金 2016 年操作来看，年初维持了较低仓位，并在市场调整过程中，买入业绩高增长估值有吸引力的优质成长股。二季度股票仓位中性，以业绩高增长的小市值成长股进攻，以估值合理增长确定性强的中盘蓝筹股防御，阶段性参与受益于通胀和供给侧改革的周期性品种。三季度在控制股票仓位的基础上，减持前期涨幅明显、估值不具备明显吸引力的小市值成长股，增持业绩增长确定性强或下半年业绩有望超预期的个股。四季度降低了股票仓位，组合配置更加均衡，减持了房地产产业链相关个股，增持了化工等受益于供给侧改革的板块。

#### 4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金在 2016 年净值增长率为 6.17%，同期业绩比较基准收益为-8.39%。

### 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，特朗普上任美国总统后政策走向的不确定性依旧将制约着全球市场风险偏好。国内经济短期企稳，后续宏观政策以稳为主，货币政策稳健中性，消费和出口将成为推动经济增长的新引擎。因此我们认为市场存在结构性机会，企业盈利增长仍然是推动上市公司市值增长的主要动因。组合管理上，重点配置符合经济发展方向、维持较快增速的子行业中的优质成长股，相对看好电子、医药、环保等子行业，同时阶段性参与国企改革、供给侧改革等主题性投资机会。在追求收益的同时，更注重风险评估和风险控制，为持有人创造稳健良好的中长期业绩回报将是我们不变的目标。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

### 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

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 审计报告

本报告期的财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本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：国泰成长优选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 | 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 | 85,970,066.35 | 13,878,857.26 |
| 结算备付金 | 1,650,983.95 | 706,389.16 |
| 存出保证金 | 396,867.05 | 144,406.60 |
| 交易性金融资产 | 294,996,813.83 | 87,103,116.09 |
| 其中：股票投资 | 294,899,091.83 | 82,977,460.09 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 97,722.00 | 4,125,656.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | 20,553,421.06 | 11,882,461.15 |
| 应收利息 | 17,769.62 | 71,103.82 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 650,669.98 | 57,000.11 |

| | | |
|---|---|---|
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| **资产总计** | **404,236,591.84** | **113,843,334.19** |
| **负债和所有者权益** | **本期末<br>2016 年 12 月 31 日** | **上年度末<br>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 | - | - |
| 应付赎回款 | 1,191,853.93 | 413,858.99 |
| 应付管理人报酬 | 507,308.57 | 140,003.93 |
| 应付托管费 | 84,551.40 | 23,334.00 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 1,121,465.26 | 255,933.24 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 64,371.17 | 261,450.92 |
| **负债合计** | **2,969,550.33** | **1,094,581.08** |
| **所有者权益：** | **-** | **-** |
| 实收基金 | 154,425,176.23 | 46,068,327.49 |
| 未分配利润 | 246,841,865.28 | 66,680,425.62 |
| **所有者权益合计** | **401,267,041.51** | **112,748,753.11** |
| **负债和所有者权益总计** | **404,236,591.84** | **113,843,334.19** |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.598 元，基金份额总额 154,425,176.23 份。

**7.2 利润表**

会计主体：国泰成长优选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<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 |
|---|---|---|
| **一、收入** | **11,445,332.59** | **53,330,511.28** |
| 1.利息收入 | 392,968.04 | 235,738.08 |
| 其中：存款利息收入 | 327,888.64 | 103,338.26 |
| 债券利息收入 | 38,196.02 | 132,399.82 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 26,883.38 | - |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 19,755,844.62 | 57,772,240.96 |
| 其中：股票投资收益 | 19,173,461.90 | 56,922,968.44 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -10,000.00 | -129,600.00 |
| 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 | 592,382.72 | 978,872.52 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -9,141,155.31 | -4,964,060.27 |
| 4.汇兑收益（损失以“一”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 437,675.24 | 286,592.51 |
| **减：二、费用** | **7,740,885.29** | **4,523,613.82** |
| 1．管理人报酬 | 3,307,928.71 | 2,007,715.86 |
| 2．托管费 | 551,321.39 | 334,619.33 |

| | | |
|---|---|---|
| 3．销售服务费 | - | - |
| 4．交易费用 | 3,488,075.84 | 1,788,494.29 |
| 5．利息支出 | - | 210.01 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | 210.01 |
| 6．其他费用 | 393,559.35 | 392,574.33 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | **3,704,447.30** | **48,806,897.46** |
| 减：所得税费用 | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | **3,704,447.30** | **48,806,897.46** |

**7.3 所有者权益（基金净值）变动表**

会计主体：国泰成长优选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<br>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） | 46,068,327.49 | 66,680,425.62 | 112,748,753.11 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 3,704,447.30 | 3,704,447.30 |
| 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） | 108,356,848.74 | 176,456,992.36 | 284,813,841.10 |
| 其中：1.基金申购款 | 245,177,980.02 | 395,379,391.98 | 640,557,372.00 |
| 2.基金赎回款 | -136,821,131.28 | -218,922,399.62 | -355,743,530.90 |
| 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） | 154,425,176.23 | 246,841,865.28 | 401,267,041.51 |
| **项目** | **上年度可比期间**<br>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） | 75,803,674.90 | 51,165,198.00 | 126,968,872.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 48,806,897.46 | 48,806,897.46 |
| 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） | -29,735,347.41 | -33,291,669.84 | -63,027,017.25 |
| 其中：1.基金申购款 | 85,983,559.33 | 120,597,748.29 | 206,581,307.62 |
| 2.基金赎回款 | -115,718,906.74 | -153,889,418.13 | -269,608,324.87 |
| 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） | 46,068,327.49 | 66,680,425.62 | 112,748,753.11 |

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：周向勇，主管会计工作负责人：周向勇，会计机构负责人：倪蓥

**7.4 报表附注**

**7.4.1 基金基本情况**

国泰成长优选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[2011]第 2129 号《关于核准国泰成长优选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由国泰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《国泰成长优选股票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 409,260,367.49 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(2012)第 077 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 409,286,744.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,377.01 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据 2014 年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》及《国泰成长优选股票型证券投资基金基金合同》，国泰成长优选股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 8 日起更名为国泰成长优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰成长优选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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产占基金资产的 60%-95%，其中投资于成长型企业的资产不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、中期票据及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5%-40%，其中，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 X80%+中证综合债券指数收益率 X20%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 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》、《国泰成长优选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**

本基金本报告期末发生会计估计变更。

**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 |
| --- | --- |
| 国泰基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 中国电力财务有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.) | 基金管理人的股东 |
| 国泰元鑫资产管理有限公司 | 基金管理人的控股子公司 |
| 中国建银投资有限责任公司(“中国建投”) | 基金管理人的控股股东 |
| 国泰全球投资管理有限公司 | 基金管理人的控股子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行交易。

#### 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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 3,307,928.71 | 2,007,715.86 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 926,607.31 | 626,638.06 |

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 1.50% / 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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 551,321.39 | 334,619.33 |

注：支付基金托管人招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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**7.4.8.4.2 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**

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**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 |
| 招商银行 | 85,970,066.35 | 303,783.41 | 13,878,857.26 | 92,546.21 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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**

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

**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(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 002821 | 凯莱英 | 2016-11-11 | 2017-11-20 | 网下新股 | 30.53 | 143.49 | 21,409.00 | 653,616.77 | 3,071,977.41 | - |
| 002840 | 华统股份 | 2016-12-29 | 2017-01-10 | 网下新股 | 6.55 | 6.55 | 1,814.00 | 11,881.70 | 11,881.70 | - |
| 601375 | 中原证券 | 2016-12-20 | 2017-01-03 | 网下新股 | 4.00 | 4.00 | 26,695.00 | 106,780.00 | 106,780.00 | - |
| 603032 | 德新交运 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下新股 | 5.81 | 5.81 | 1,628.00 | 9,458.68 | 9,458.68 | - |
| 603035 | 常熟汽饰 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下新股 | 10.44 | 10.44 | 2,316.00 | 24,179.04 | 24,179.04 | - |
| 603186 | 华正新材 | 2016-12-26 | 2017-01-03 | 网下新股 | 5.37 | 5.37 | 1,874.00 | 10,063.38 | 10,063.38 | - |
| 603228 | 景旺电子 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 网下新股 | 23.16 | 23.16 | 1,559.00 | 36,106.44 | 36,106.44 | - |
| 603266 | 天龙股份 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下新股 | 14.63 | 14.63 | 1,562.00 | 22,852.06 | 22,852.06 | - |
| 60366 | 苏州 | 2016-1 | 2017-1 | 网下 | 8.03 | 32.22 | 26,007 | 208,83 | 837,94 | - |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 0 | 科达 | 1-21 | 2-01 | 新股 | | | .00 | 6.21 | 5.54 | |
| 603689 | 皖天然气 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下新股 | 7.87 | 7.87 | 4,818.00 | 37,917.66 | 37,917.66 | - |
| 603823 | 百合花 | 2016-12-09 | 2017-12-20 | 网下新股 | 10.60 | 32.74 | 36,764.00 | 389,698.40 | 1,203,653.36 | - |
| 603877 | 太平鸟 | 2016-12-29 | 2017-01-09 | 网下新股 | 21.30 | 21.30 | 3,180.00 | 67,734.00 | 67,734.00 | - |
| 300583 | 赛托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 网下新股 | 40.29 | 40.29 | 1,582.00 | 63,738.78 | 63,738.78 | - |
| 300586 | 美联新材 | 2016-12-26 | 2017-01-04 | 网下新股 | 9.30 | 9.30 | 1,006.00 | 9,355.80 | 9,355.80 | - |
| 300587 | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 网下新股 | 14.11 | 14.11 | 1,438.00 | 20,290.18 | 20,290.18 | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下新股 | 4.94 | 4.94 | 1,380.00 | 6,817.20 | 6,817.20 | - |
| 300591 | 万里马 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下新股 | 3.07 | 3.07 | 2,397.00 | 7,358.79 | 7,358.79 | - |

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(单位：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 | 12.68 | - | - | 646,600.00 | 7,305,860.20 | 8,198,888.00 | - |

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**

本基金本报告期末无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。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无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。

**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 281,249,815.81 元，属于第二层次的余额为 13,746,998.02 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 81,035,757.88 元，第二层次 6,067,358.21 元，无属于第三层次的余额)。

(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 | 294,899,091.83 | 72.95 |
| | 其中：股票 | 294,899,091.83 | 72.95 |
| 2 | 固定收益投资 | 97,722.00 | 0.02 |
| | 其中：债券 | 97,722.00 | 0.02 |
| | 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 | - | - |
| | 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 | 87,621,050.30 | 21.68 |
| 7 | 其他各项资产 | 21,618,727.71 | 5.35 |
| 8 | 合计 | 404,236,591.84 | 100.00 |

**8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

| 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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 288,561,076.06 | 71.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 37,917.66 | 0.01 |
| E | 建筑业 | 15,592.23 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 9,458.68 | 0.00 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 241,692.20 | 0.06 |
| J | 金融业 | 106,780.00 | 0.03 |
| 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 | 5,926,575.00 | 1.48 |
| S | 综合 | - | - |
|  | 合计 | 294,899,091.83 | 73.49 |

**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 | 600056 | 中国医药 | 1,724,240 | 32,812,287.20 | 8.18 |
| 2 | 300115 | 长盈精密 | 1,248,947 | 32,547,558.82 | 8.11 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 3 | 002456 | 欧菲光 | 940,881 | 32,253,400.68 | 8.04 |
| 4 | 300145 | 中金环境 | 934,384 | 24,387,422.40 | 6.08 |
| 5 | 600885 | 宏发股份 | 634,655 | 20,277,227.25 | 5.05 |
| 6 | 002241 | 歌尔股份 | 529,100 | 14,031,732.00 | 3.50 |
| 7 | 002426 | 胜利精密 | 1,608,795 | 13,304,734.65 | 3.32 |
| 8 | 002475 | 立讯精密 | 617,296 | 12,808,892.00 | 3.19 |
| 9 | 600596 | 新安股份 | 1,152,560 | 11,802,214.40 | 2.94 |
| 10 | 000422 | 湖北宜化 | 1,383,338 | 10,997,537.10 | 2.74 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 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 | 300115 | 长盈精密 | 67,299,612.29 | 59.69 |
| 2 | 002426 | 胜利精密 | 57,734,566.89 | 51.21 |
| 3 | 300207 | 欣旺达 | 56,097,846.22 | 49.75 |
| 4 | 002456 | 欧菲光 | 48,598,061.55 | 43.10 |
| 5 | 600056 | 中国医药 | 44,064,106.89 | 39.08 |
| 6 | 002241 | 歌尔股份 | 42,211,417.65 | 37.44 |
| 7 | 002310 | 东方园林 | 41,856,033.22 | 37.12 |
| 8 | 300197 | 铁汉生态 | 36,667,258.94 | 32.52 |
| 9 | 002236 | 大华股份 | 36,271,263.59 | 32.17 |
| 10 | 300145 | 中金环境 | 35,760,301.85 | 31.72 |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 35,582,905.18 | 31.56 |
| 12 | 600522 | 中天科技 | 35,477,302.22 | 31.47 |
| 13 | 002138 | 顺络电子 | 35,132,983.18 | 31.16 |
| 14 | 600487 | 亨通光电 | 32,403,932.11 | 28.74 |
| 15 | 600885 | 宏发股份 | 29,076,996.84 | 25.79 |
| 16 | 002411 | 必康股份 | 27,986,300.83 | 24.82 |
| 17 | 300426 | 唐德影视 | 25,266,777.70 | 22.41 |
| 18 | 300058 | 蓝色光标 | 24,520,389.57 | 21.75 |
| 19 | 300136 | 信维通信 | 22,869,017.26 | 20.28 |
| 20 | 300296 | 利亚德 | 21,855,186.13 | 19.38 |
| 21 | 002217 | 合力泰 | 19,480,464.88 | 17.28 |
| 22 | 300237 | 美晨科技 | 18,780,983.63 | 16.66 |
| 23 | 600104 | 上汽集团 | 17,705,202.65 | 15.70 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 24 | 002589 | 瑞康医药 | 17,287,563.00 | 15.33 |
| 25 | 601633 | 长城汽车 | 16,637,505.72 | 14.76 |
| 26 | 000725 | 京东方 A | 15,983,422.00 | 14.18 |
| 27 | 002035 | 华帝股份 | 15,650,430.56 | 13.88 |
| 28 | 600068 | 葛洲坝 | 15,628,728.00 | 13.86 |
| 29 | 600997 | 开滦股份 | 14,193,079.45 | 12.59 |
| 30 | 000568 | 泸州老窖 | 13,104,253.42 | 11.62 |
| 31 | 600298 | 安琪酵母 | 12,569,885.49 | 11.15 |
| 32 | 300203 | 聚光科技 | 12,532,735.33 | 11.12 |
| 33 | 000860 | 顺鑫农业 | 12,124,841.90 | 10.75 |
| 34 | 600596 | 新安股份 | 11,549,235.90 | 10.24 |
| 35 | 600096 | 云天化 | 11,359,210.44 | 10.07 |
| 36 | 002179 | 中航光电 | 11,336,622.46 | 10.05 |
| 37 | 002701 | 奥瑞金 | 10,945,217.46 | 9.71 |
| 38 | 600337 | 美克家居 | 10,759,491.41 | 9.54 |
| 39 | 000422 | 湖北宜化 | 10,588,625.76 | 9.39 |
| 40 | 002450 | 康得新 | 10,372,367.92 | 9.20 |
| 41 | 000910 | 大亚圣象 | 9,494,305.32 | 8.42 |
| 42 | 300336 | 新文化 | 9,441,652.06 | 8.37 |
| 43 | 002635 | 安洁科技 | 9,272,052.70 | 8.22 |
| 44 | 601012 | 隆基股份 | 9,262,146.95 | 8.21 |
| 45 | 300017 | 网宿科技 | 9,234,761.00 | 8.19 |
| 46 | 002050 | 三花智控 | 9,164,261.24 | 8.13 |
| 47 | 600183 | 生益科技 | 8,957,309.31 | 7.94 |
| 48 | 002508 | 老板电器 | 8,838,537.10 | 7.84 |
| 49 | 600348 | 阳泉煤业 | 8,762,503.50 | 7.77 |
| 50 | 600664 | 哈药股份 | 8,159,800.54 | 7.24 |
| 51 | 600409 | 三友化工 | 8,019,358.00 | 7.11 |
| 52 | 600110 | 诺德股份 | 7,595,844.00 | 6.74 |
| 53 | 002509 | 天广中茂 | 7,305,860.20 | 6.48 |
| 54 | 600021 | 上海电力 | 7,024,690.71 | 6.23 |
| 55 | 002400 | 省广股份 | 6,939,236.50 | 6.15 |
| 56 | 600691 | 阳煤化工 | 6,746,668.00 | 5.98 |
| 57 | 002234 | 民和股份 | 6,655,383.99 | 5.90 |
| 58 | 002458 | 益生股份 | 6,647,856.00 | 5.90 |
| 59 | 600872 | 中炬高新 | 6,575,954.00 | 5.83 |
| 60 | 601186 | 中国铁建 | 6,261,378.00 | 5.55 |
| 61 | 600528 | 中铁工业 | 6,200,421.00 | 5.50 |
| 62 | 601009 | 南京银行 | 6,197,313.00 | 5.50 |
| 63 | 002142 | 宁波银行 | 6,194,962.84 | 5.49 |
| 64 | 002008 | 大族激光 | 6,181,366.31 | 5.48 |
| 65 | 600141 | 兴发集团 | 5,974,822.19 | 5.30 |
| 66 | 600690 | 青岛海尔 | 5,931,258.80 | 5.26 |
| 67 | 300148 | 天舟文化 | 5,804,092.80 | 5.15 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 68 | 300232 | 洲明科技 | 5,719,680.52 | 5.07 |
| 69 | 600240 | 华业资本 | 5,604,694.02 | 4.97 |
| 70 | 000983 | 西山煤电 | 5,553,528.00 | 4.93 |
| 71 | 002343 | 慈文传媒 | 5,537,054.00 | 4.91 |
| 72 | 300269 | 联建光电 | 5,486,825.87 | 4.87 |
| 73 | 600338 | 西藏珠峰 | 5,011,987.00 | 4.45 |
| 74 | 300389 | 艾比森 | 4,938,143.00 | 4.38 |
| 75 | 002572 | 索菲亚 | 4,855,062.00 | 4.31 |
| 76 | 000603 | 盛达矿业 | 4,750,305.00 | 4.21 |
| 77 | 000333 | 美的集团 | 4,518,242.98 | 4.01 |
| 78 | 600518 | 康美药业 | 4,392,926.00 | 3.90 |
| 79 | 601808 | 中海油服 | 4,350,112.00 | 3.86 |
| 80 | 600335 | 国机汽车 | 4,310,997.21 | 3.82 |
| 81 | 002311 | 海大集团 | 4,267,718.41 | 3.79 |
| 82 | 600355 | 精伦电子 | 4,200,599.32 | 3.73 |
| 83 | 002329 | 皇氏集团 | 4,195,858.60 | 3.72 |
| 84 | 002479 | 富春环保 | 4,092,478.00 | 3.63 |
| 85 | 300274 | 阳光电源 | 4,027,425.55 | 3.57 |
| 86 | 300071 | 华谊嘉信 | 3,978,375.70 | 3.53 |
| 87 | 300150 | 世纪瑞尔 | 3,822,509.22 | 3.39 |
| 88 | 002507 | 涪陵榨菜 | 3,819,373.20 | 3.39 |
| 89 | 002001 | 新 和 成 | 3,796,352.85 | 3.37 |
| 90 | 600566 | 济川药业 | 3,395,317.00 | 3.01 |
| 91 | 601199 | 江南水务 | 3,271,408.20 | 2.90 |
| 92 | 002557 | 洽洽食品 | 3,223,421.14 | 2.86 |
| 93 | 601126 | 四方股份 | 3,141,760.00 | 2.79 |
| 94 | 603008 | 喜临门 | 3,097,279.00 | 2.75 |
| 95 | 002548 | 金新农 | 3,096,470.80 | 2.75 |
| 96 | 000967 | 盈峰环境 | 3,037,756.32 | 2.69 |
| 97 | 600060 | 海信电器 | 3,028,219.00 | 2.69 |
| 98 | 601699 | 潞安环能 | 3,027,668.00 | 2.69 |
| 99 | 002131 | 利欧股份 | 2,673,794.07 | 2.37 |
| 100 | 600998 | 九州通 | 2,667,183.73 | 2.37 |
| 101 | 601607 | 上海医药 | 2,614,732.89 | 2.32 |
| 102 | 002374 | 丽鹏股份 | 2,460,816.00 | 2.18 |
| 103 | 002511 | 中顺洁柔 | 2,327,278.00 | 2.06 |

注：买入金额按买入成交金额（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（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 300207 | 欣旺达 | 59,821,260.30 | 53.06 |
| 2 | 002426 | 胜利精密 | 39,102,082.33 | 34.68 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 38,703,938.31 | 34.33 |
| 4 | 600487 | 亨通光电 | 37,573,645.00 | 33.33 |
| 5 | 002310 | 东方园林 | 36,670,615.57 | 32.52 |
| 6 | 300197 | 铁汉生态 | 36,011,994.11 | 31.94 |
| 7 | 002138 | 顺络电子 | 35,435,936.19 | 31.43 |
| 8 | 300115 | 长盈精密 | 35,129,108.88 | 31.16 |
| 9 | 600522 | 中天科技 | 32,980,017.76 | 29.25 |
| 10 | 002411 | 必康股份 | 31,928,220.97 | 28.32 |
| 11 | 300296 | 利亚德 | 27,210,940.77 | 24.13 |
| 12 | 002241 | 歌尔股份 | 26,189,189.60 | 23.23 |
| 13 | 300058 | 蓝色光标 | 25,204,568.92 | 22.35 |
| 14 | 002475 | 立讯精密 | 24,601,617.92 | 21.82 |
| 15 | 300136 | 信维通信 | 22,973,565.25 | 20.38 |
| 16 | 300426 | 唐德影视 | 21,135,826.02 | 18.75 |
| 17 | 002035 | 华帝股份 | 17,597,195.57 | 15.61 |
| 18 | 300145 | 中金环境 | 16,879,984.80 | 14.97 |
| 19 | 300237 | 美晨科技 | 16,678,902.52 | 14.79 |
| 20 | 002589 | 瑞康医药 | 16,668,820.94 | 14.78 |
| 21 | 002635 | 安洁科技 | 16,536,218.15 | 14.67 |
| 22 | 600068 | 葛洲坝 | 16,523,342.10 | 14.66 |
| 23 | 000725 | 京东方 A | 16,358,374.28 | 14.51 |
| 24 | 002450 | 康得新 | 15,921,332.13 | 14.12 |
| 25 | 601633 | 长城汽车 | 15,893,496.65 | 14.10 |
| 26 | 600997 | 开滦股份 | 13,872,418.24 | 12.30 |
| 27 | 000568 | 泸州老窖 | 12,887,950.26 | 11.43 |
| 28 | 300203 | 聚光科技 | 12,606,283.61 | 11.18 |
| 29 | 600298 | 安琪酵母 | 12,323,353.00 | 10.93 |
| 30 | 002456 | 欧菲光 | 12,299,068.82 | 10.91 |
| 31 | 002179 | 中航光电 | 12,186,214.20 | 10.81 |
| 32 | 600337 | 美克家居 | 11,526,828.35 | 10.22 |
| 33 | 600096 | 云天化 | 11,333,338.12 | 10.05 |
| 34 | 600056 | 中国医药 | 10,908,337.75 | 9.67 |
| 35 | 002217 | 合力泰 | 10,734,701.79 | 9.52 |
| 36 | 002701 | 奥瑞金 | 10,448,474.49 | 9.27 |
| 37 | 000910 | 大亚圣象 | 9,912,561.01 | 8.79 |
| 38 | 601012 | 隆基股份 | 9,857,905.49 | 8.74 |
| 39 | 002050 | 三花智控 | 9,653,530.20 | 8.56 |
| 40 | 600183 | 生益科技 | 9,372,046.00 | 8.31 |
| 41 | 600104 | 上汽集团 | 9,159,357.24 | 8.12 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 42 | 300336 | 新文化 | 9,057,966.52 | 8.03 |
| 43 | 002508 | 老板电器 | 8,984,898.43 | 7.97 |
| 44 | 600348 | 阳泉煤业 | 8,974,218.59 | 7.96 |
| 45 | 300017 | 网宿科技 | 8,618,687.73 | 7.64 |
| 46 | 300232 | 洲明科技 | 8,583,963.60 | 7.61 |
| 47 | 600021 | 上海电力 | 8,228,555.16 | 7.30 |
| 48 | 300269 | 联建光电 | 8,174,726.40 | 7.25 |
| 49 | 601186 | 中国铁建 | 7,860,382.60 | 6.97 |
| 50 | 600885 | 宏发股份 | 7,657,332.00 | 6.79 |
| 51 | 300389 | 艾比森 | 7,462,308.54 | 6.62 |
| 52 | 002400 | 省广股份 | 7,168,348.71 | 6.36 |
| 53 | 600872 | 中炬高新 | 7,027,045.00 | 6.23 |
| 54 | 002142 | 宁波银行 | 6,931,442.00 | 6.15 |
| 55 | 002458 | 益生股份 | 6,635,386.69 | 5.89 |
| 56 | 002234 | 民和股份 | 6,443,020.00 | 5.71 |
| 57 | 600240 | 华业资本 | 6,279,638.00 | 5.57 |
| 58 | 600528 | 中铁工业 | 6,255,358.00 | 5.55 |
| 59 | 601009 | 南京银行 | 6,185,799.55 | 5.49 |
| 60 | 300148 | 天舟文化 | 6,042,541.00 | 5.36 |
| 61 | 000983 | 西山煤电 | 5,807,004.50 | 5.15 |
| 62 | 002572 | 索菲亚 | 5,571,448.41 | 4.94 |
| 63 | 600690 | 青岛海尔 | 5,546,450.23 | 4.92 |
| 64 | 002343 | 慈文传媒 | 5,473,086.02 | 4.85 |
| 65 | 002329 | 皇氏集团 | 5,457,433.74 | 4.84 |
| 66 | 600338 | 西藏珠峰 | 5,136,229.30 | 4.56 |
| 67 | 002008 | 大族激光 | 4,877,036.09 | 4.33 |
| 68 | 000333 | 美的集团 | 4,780,060.00 | 4.24 |
| 69 | 000967 | 盈峰环境 | 4,572,754.41 | 4.06 |
| 70 | 000603 | 盛达矿业 | 4,528,639.00 | 4.02 |
| 71 | 600335 | 国机汽车 | 4,407,359.76 | 3.91 |
| 72 | 601808 | 中海油服 | 4,242,637.56 | 3.76 |
| 73 | 002104 | 恒宝股份 | 4,219,265.95 | 3.74 |
| 74 | 300274 | 阳光电源 | 4,213,301.29 | 3.74 |
| 75 | 600355 | 精伦电子 | 4,178,871.17 | 3.71 |
| 76 | 600518 | 康美药业 | 4,123,667.50 | 3.66 |
| 77 | 002001 | 新 和 成 | 4,070,694.16 | 3.61 |
| 78 | 002507 | 涪陵榨菜 | 4,056,662.73 | 3.60 |
| 79 | 300071 | 华谊嘉信 | 4,025,517.60 | 3.57 |
| 80 | 002311 | 海大集团 | 3,976,853.05 | 3.53 |
| 81 | 300376 | 易事特 | 3,929,763.23 | 3.49 |
| 82 | 300150 | 世纪瑞尔 | 3,872,296.86 | 3.43 |
| 83 | 002548 | 金新农 | 3,822,574.27 | 3.39 |
| 84 | 601799 | 星宇股份 | 3,671,944.73 | 3.26 |
| 85 | 002479 | 富春环保 | 3,657,597.20 | 3.24 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 86 | 600566 | 济川药业 | 3,496,630.00 | 3.10 |
| 87 | 601699 | 潞安环能 | 3,196,587.00 | 2.84 |
| 88 | 300133 | 华策影视 | 3,105,924.28 | 2.75 |
| 89 | 002557 | 洽洽食品 | 3,097,406.57 | 2.75 |
| 90 | 002511 | 中顺洁柔 | 3,049,844.62 | 2.70 |
| 91 | 002131 | 利欧股份 | 2,984,928.06 | 2.65 |
| 92 | 600110 | 诺德股份 | 2,973,141.00 | 2.64 |
| 93 | 600060 | 海信电器 | 2,938,549.32 | 2.61 |
| 94 | 601126 | 四方股份 | 2,913,081.75 | 2.58 |
| 95 | 601199 | 江南水务 | 2,828,355.60 | 2.51 |
| 96 | 002374 | 丽鹏股份 | 2,731,002.00 | 2.42 |
| 97 | 000860 | 顺鑫农业 | 2,712,689.20 | 2.41 |
| 98 | 603008 | 喜临门 | 2,689,660.99 | 2.39 |
| 99 | 600511 | 国药股份 | 2,646,952.00 | 2.35 |
| 100 | 600998 | 九州通 | 2,624,885.41 | 2.33 |
| 101 | 601607 | 上海医药 | 2,480,482.00 | 2.20 |
| 102 | 600563 | 法拉电子 | 2,472,800.16 | 2.19 |
| 103 | 603609 | 禾丰牧业 | 2,402,531.14 | 2.13 |
| 104 | 002111 | 威海广泰 | 2,401,155.96 | 2.13 |
| 105 | 600197 | 伊力特 | 2,347,350.00 | 2.08 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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 | 1,438,145,657.10 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,236,274,265.95 |

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 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 97,722.00 | 0.02 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 97,722.00 | 0.02 |

**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 | 110031 | 航信转债 | 900 | 97,722.00 | 0.02 |

**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。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

8.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体（除“歌尔股份”公告其违规情况外），没有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 7 月 14 日，歌尔股份有限公司（以下简称“公司”）于 2016 年 7 月 14 日收到中国证券监督管理委员会山东监管局（以下简称“山东证监局”）《关于对歌尔股份有限公司采取责令改正措施的决定》，山东证监局在对公司现场检查中发现公司定期报告、利润分配、员工持股计划、 重大事项停牌等重大事项中内幕信息知情人档案，未登记董事、监事、高级管理人 员、签字会计师以外的审计机构项目组成员、重要财务岗位人员知悉内幕信息情况， 未按照内幕信息决策程序披露所涉及的岗位和人员情况，以及登记的内幕信息知情 ，人与该事项所需的审批权限明显不匹配等问题。

本基金管理人此前投资歌尔股份股票时，已经严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本基金股票池，而后进行了投资，并且是在此事件发生公布后，才进行买入操作，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本基金管理人就此事件进行了及时分析和研究，认为对公司 17 年经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

**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 | 396,867.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | 20,553,421.06 |

| | | |
|---|---|---|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 17,769.62 |
| 5 | 应收申购款 | 650,669.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,618,727.71 |

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110031 | 航信转债 | 97,722.00 | 0.02 |

**8.12.5 期末前十名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的情况。

## §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 |
| 16,148 | 9,563.11 | 53,004,386.37 | 34.32% | 101,420,789.86 | 65.68% |

**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 | 178,608.54 | 0.12% |

**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 |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
| --- | --- |
| 基金合同生效日(2012 年 3 月 20 日)基金份额总额 | 409,286,744.50 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 46,068,327.49 |
| 本报告期基金总申购份额 | 245,177,980.02 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 136,821,131.28 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 154,425,176.23 |

## §11 重大事件揭示

**11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内，本基金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**

报告期内基金管理人重大人事变动如下：

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司督察长任职公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，聘任李永梅女士担任公司督察长；

2016 年 3 月 26 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十四次会议审议通过，巴立康先生不再担任本基金管理人副总经理，且不再代为履行督察长职务；

2016 年 6 月 8 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十五次会议审议通过，张峰先生不再担任本基金管理人总经理，由公司董事长唐建光先生代为履行总经理职务；

2016 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第二十六次会议审议通过，聘任周向勇先生担任本基金管理人总经理，

公司董事长唐建光先生不再代为履行总经理职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

**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，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

**11.4 基金投资策略的改变**

报告期内，本基金投资策略无改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所无改聘情况。报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 60,000 元，目前的审计机构已提供审计服务的年限为 5 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，基金管理人、托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

**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比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | 691,128,472.73 | 25.89% | 505,424.81 | 25.08% | - |
| 广发证券 | 1 | 499,383,001.07 | 18.71% | 365,200.43 | 18.12% | - |
| 光大证券 | 1 | 475,962,929.16 | 17.83% | 348,073.16 | 17.27% | - |
| 西南证券 | 1 | 456,173,261.09 | 17.09% | 333,602.70 | 16.56% | 本期新增 |
| 招商证券 | 1 | 267,497,467.06 | 10.02% | 249,117.40 | 12.36% | - |
| 川财证券 | 2 | 233,133,074.26 | 8.73% | 170,489.05 | 8.46% | - |
| 德邦证券 | 1 | 46,260,438.17 | 1.73% | 43,082.42 | 2.14% | - |

注：（1）资力雄厚，信誉良好；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

**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 |
| 西南证券 | - | - | 30,100,000.00 | 38.49% | - | - |
| 招商证券 | - | - | 48,100,000.00 | 61.51% | - | - |