

(上接B57版)

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	6,345,500.00	1.78
B	采矿业	85,959,807.33	24.11
C	制造业	96,409,992.81	27.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,234.48	0.01
F	批发和零售业	12,824,084.00	3.60
G	交通运输、仓储和邮政业	17,880,000.00	5.02
H	信息传输、软件和信息技术服务业	525,700.00	0.15
I	金融业	-	-
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生、医药和公共服务业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	其他金融工具	-	-
R	基金投资	-	-
S	合计	220,041,327.72	61.73

3. 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600348	烟台发展	2,959,958	17,549,716.50	4.92
2	600961	烟台集团	1,550,033	18,816,477.00	4.44
3	000983	西山煤电	1,999,924	15,059,427.72	4.13
4	601699	潞安环能	2,029,990	14,798,627.10	4.25
5	000033	神华股份	2,500,000	14,350,000.00	4.03
6	000977	开平能源	2,199,976	11,593,875.32	3.25
7	600985	西昌电力	1,100,000	10,164,000.00	2.85
8	000029	招商局蛇口	3,100,000	9,488,000.00	2.66
9	000059	华鲁恒升	2,000,000	9,400,000.00	2.64
10	600994	蓝星新材	350,000	8,937,500.00	2.51

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券

5. 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债券投资明细

本基金本报告期末持有债券

6. 报告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

本基金本报告期末持有资产支持证券

7. 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

本基金本报告期末持有贵金属

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权证投资明细

本基金本报告期末持有权证

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的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、处罚的情形

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券未超过基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	90,825.03
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	39,798.34
5	其他应收款	2,590.54
6	其他流动资产	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	133,213.91

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

2016年6月22日至2016年6月31日止期间基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较如下图所示:

注:本基金2015年6月2日成立,已达标业绩比较基准比例要求,本基金的比较基准是:沪深300指数收益率×66%+上证国债指数收益率×34%

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

2016年6月22日至2016年6月31日止期间基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较如下图所示:

注:本基金2015年6月2日成立,已达标业绩比较基准比例要求,本基金的比较基准是:沪深300指数收益率×66%+上证国债指数收益率×34%

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(5) 报告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	期末持有份额(股)	占基金资产净值比例(%)	受限流通情况
1	601699	潞安环能	14,798,627.10	4.15	重大资产重组

(6) 投资组合报告期内投资的其他公允价值受限资产

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

五、 投资业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,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。

本基金的托管人交通银行股份有限公司根据相关法律法规的规定,复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

(一)基金业绩比较

本基金合同生效日为2015年6月2日,基金合同生效以来(截至2015年9月30日)的投资业绩及与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	③-④	⑤-⑥
2015.6.2-2015.12.31	2.30%	0.40%	-13.76%	1.66%	16.00%
2016.1.1-2016.3.31	-2.83%	1.35%	-7.64%	4.81%	-0.11%
2015.6.2-2016.3.31	-0.60%	0.80%	-20.35%	1.60%	19.75%

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

(二)基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较

本基金净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2015年6月2日至2016年6月31日)

注:本基金2015年6月2日成立,已达标业绩比较基准比例要求,本基金的比较基准是:沪深300指数收益率×66%+上证国债指数收益率×34%

六、 基金费用的申购赎回费用

(一)申购与赎回的原则

(1)“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

(2)“金额申购、份额赎回”原则,即申购以金额申请,赎回以份额申请。

(3)当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

(4)赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回。

基金管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

2.申购和赎回的程序

1.申购和赎回的申请方式

投资者申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资者交付申购款项,申购成立;基金份额登记机构确认基金份额时,申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;基金份额登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者赎回申请成功后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时,款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

2.申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资者可在T+2日(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式向销售机构确认申请情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资者。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。

(二)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费

2.基金托管人的托管费

3.基金销售服务费

4.基金赎回费

5.基金转换费

6.基金账户管理费

7.基金信息披露费

8.基金持有人大会费用

9.基金投资运作费用

10.基金销售机构佣金

11.基金注册登记费

12.基金开户费

13.基金账户管理费

14.基金销售服务费

15.基金赎回费

16.基金转换费

17.基金账户管理费

18.基金销售服务费

19.基金赎回费

20.基金转换费

21.基金账户管理费

22.基金销售服务费

23.基金赎回费

24.基金转换费

25.基金账户管理费

26.基金销售服务费

27.基金赎回费

28.基金转换费

29.基金账户管理费

30.基金销售服务费

31.基金赎回费

32.基金转换费

33.基金账户管理费

34.基金销售服务费

35.基金赎回费

36.基金转换费

37.基金账户管理费

38.基金销售服务费

39.基金赎回费

40.基金转换费

41.基金账户管理费

42.基金销售服务费

43.基金赎回费

44.基金转换费

45.基金账户管理费

46.基金销售服务费

47.基金赎回费

48.基金转换费

49.基金账户管理费

50.基金销售服务费

51.基金赎回费

52.基金转换费

53.基金账户管理费

54.基金销售服务费

55.基金赎回费

56.基金转换费

57.基金账户管理费

58.基金销售服务费

59.基金赎回费

60.基金转换费

61.基金账户管理费

62.基金销售服务费

63.基金赎回费

64.基金转换费

65.基金账户管理费

66.基金销售服务费

67.基金赎回费

68.基金转换费

69.基金账户管理费

70.基金销售服务费

71.基金赎回费

72.基金转换费

73.基金账户管理费

74.基金销售服务费

75.基金赎回费

76.基金转换费

77.基金账户管理费

78.基金销售服务费

79.基金赎回费

80.基金转换费

81.基金账户管理费

82.基金销售服务费

83.基金赎回费

84.基金转换费

85.基金账户管理费

86.基金销售服务费

87.基金赎回费

88.基金转换费

89.基金账户管理费

90.基金销售服务费

91.基金赎回费

92.基金转换费

93.基金账户管理费

94.基金销售服务费

95.基金赎回费

96.基金转换费

97.基金账户管理费

98.基金销售服务费

99.基金赎回费

100.基金转换费

101.基金账户管理费

102.基金销售服务费

103.基金赎回费

104.基金转换费

105.基金账户管理费

106.基金销售服务费

107.基金赎回费

108.基金转换费

109.基金账户管理费

110.基金销售服务费

111.基金赎回费

112.基金转换费

113.基金账户管理费

114.基金销售服务费

115.基金赎回费

116.基金转换费

117.基金账户管理费

118.基金销售服务费

119.基金赎回费

120.基金转换费

121.基金账户管理费

122.基金销售服务费

123.基金赎回费

124.基金转换费

125.基金账户管理费

126.基金销售服务费

127.基金赎回费

128.基金转换费

129.基金账户管理费

130.基金销售服务费

131.基金赎回费

132.基金转换费

133.基金账户管理费

134.基金销售服务费

135.基金赎回费

136.基金转换费

137.基金账户管理费

138.基金销售服务费

139.基金赎回费

140.基金转换费

141.基金账户管理费

142.基金销售服务费

143.基金赎回费

144.基金转换费

145.基金账户管理费

146.基金销售服务费

147.基金赎回费

148.基金转换费

149.基金账户管理费

150.基金销售服务费

151.基金赎回费

152.基金转换费

153.基金账户管理费

154.基金销售服务费

155.基金赎回费

156.基金转换费

157.基金账户管理费

158.基金销售服务费

159.基金赎回费

160.基金转换费

161.基金账户管理费

162.基金销售服务费

163.基金赎回费

164.基金转换费

165.基金账户管理费

166.基金销售服务费

167.基金赎回费

168.基金转换费

169.基金账户管理费

170.基金销售服务费

171.基金赎回费

172.基金转换费

173.基金账户管理费

174.基金销售服务费

175.基金赎回费

176.基金转换费

177.基金账户管理费

178.基金销售服务费

179.基金赎回费

180.基金转换费

181.基金账户管理费

182.基金销售服务费

183.基金赎回费

184.基金转换费

185.基金账户管理费

186.基金销售服务费

187.基金赎回费

188.基金转换费

189.基金账户管理费

190.基金销售服务费

191.基金赎回费

192.基金转换费

193.基金账户管理费

194.基金销售服务费

195.基金赎回费

196.基金转换费

197.基金账户管理费

198.基金销售服务费

199.基金赎回费

200.基金转换费

201.基金账户管理费

202.基金销售服务费

203.基金赎回费

204.基金转换费

205.基金账户管理费

206.基金销售服务费

207.基金赎回费

208.基金转换费

209.基金账户管理费

210.基金销售服务费

211.基金赎回费

212.基金转换费

213.基金账户管理费

214.基金销售服务费

215.基金赎回费

216.基金转换费