

2016年6月30日

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

2016年6月30日

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	101,361.36	0.01

C	采矿业	17,437,990.40	0.85
C	制造业	356,768,122.14	17.48
D	电力、热、燃气生产和供应业	18,064,404.00	0.93
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	11,976,236.66	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,051,965.90	1.72
J	金融业	51,928,664.00	2.54
K	房地产业	--	--
L	租赁和商务服务业	21,338,421.10	1.05
M	科学研究和技术服务业	116,681.75	0.01
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	15,900,088.00	0.78
R	文化、体育和娱乐业	25,398,624.71	1.26
S	综合	--	--
	合计	555,071,530.02	27.20

序号	企业名称	营业收入	净利润	净资产	总资产	资产负债率	净资产收益率
1	600009 万邦医药	2,286,960	29,454,207.00	1.93			
2	002500 山西证券	1,821,900	30,170,666.00	1.48			
3	601689 龙信集团	900,000	29,655,000.00	1.45			
4	002612 横店影视	1,121,400	27,956,502.00	1.37			
5	900748 华友集团	623,800	23,342,560.00	1.14			
6	601688 华泰证券	1,586,000	23,258,000.00	1.07			
7	300136 松发文化	719,231	17,966,040.34	0.98			
8	000707 众成文化	879,937	17,862,421.10	0.91			
9	002527 众合食品	888,146	16,555,041.44	0.81			
10	000996 吉岭纸业	304,828	16,342,702.60	0.80			

4 报告期末按投资组合品种分类的债券投资组合		
	持仓价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1 国债投资	--	--
2 央行票据	--	--
3 金融债券	50,020,000.00	2.45
其中：政策性金融债券	50,020,000.00	2.45
4 企业债券	196,283,113.88	9.62
5 企业中期票据投资	95,548,000.00	4.54
6 中期票据	30,010,000.00	1.47
7 可转换	954,979,223.72	46.80
8 资产支持	--	--
9 其他	--	--
10 合计	1,321,826,417.60	64.78

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	126018	08江铜债	3,243,600	322,997,688.00	15.83
2	110032	三一转债	1,854,300	197,204,805.00	9.66
3	132004	15国电KB	1,712,520	165,789,061.20	8.12

4	122005	15年度PE	577,670	62,105,301.70	3.04
5	01199765	15年度WFOE	600,000	60,420,000.00	2.96
5.6	报告期末公允价值估值基金资产净值占期末大非限售的前十名主要投资证券支持度				
5.6.1	本基金报告期末公允价值支持度				
5.7	报告期末按公允价值估值基金资产净值占期末大非限售的前十名主要投资证券支持度				
5.7.1	本基金报告期末公允价值支持度				
5.8	报告期末公允价值估值基金资产净值占期末大非限售的前五名权证投资证券支持度				
5.8.1	本基金报告期末公允价值支持度				
5.9	报告期末基金投资的股指期货交易情况说明				
5.9.1	报告期末基金投资的股指期货持仓损益和公允价值变动损益				
5.9.2	报告期末基金投资的股指期货投资收益				
5.10	股指期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.10.1	报告期末基金投资的国债期货交易情况说明				
5.10.2	本期国债期货持仓情况				
5.10.3	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.10.4	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.10.5	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.10.6	本期国债期货投资情况				
5.10.7	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11	股指期货持仓损益				
5.11.1	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.2	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.3	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.4	本期国债期货投资情况				
5.11.5	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.6	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.11.7	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.11.8	本期国债期货投资情况				
5.11.9	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.10	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.11	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.12	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.13	本期国债期货投资情况				
5.11.14	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.15	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.11.16	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.11.17	本期国债期货投资情况				
5.11.18	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.19	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.20	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.21	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.22	本期国债期货投资情况				
5.11.23	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.24	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.11.25	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.11.26	本期国债期货投资情况				
5.11.27	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.28	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.29	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.30	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.31	本期国债期货投资情况				
5.11.32	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				

4	122005	15年度PE	577,670	62,105,301.70	3.04
5	01199765	15年度WFOE	600,000	60,420,000.00	2.96
5.6	报告期末公允价值估值基金资产净值占期末大非限售的前十名主要投资证券支持度				
5.6.1	本基金报告期末公允价值支持度				
5.7	报告期末按公允价值估值基金资产净值占期末大非限售的前十名主要投资证券支持度				
5.7.1	本基金报告期末公允价值支持度				
5.8	报告期末公允价值估值基金资产净值占期末大非限售的前五名权证投资证券支持度				
5.8.1	本基金报告期末公允价值支持度				
5.9	报告期末基金投资的股指期货交易情况说明				
5.9.1	报告期末基金投资的股指期货持仓损益和公允价值变动损益				
5.9.2	报告期末基金投资的股指期货投资收益				
5.10	股指期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.10.1	报告期末基金投资的国债期货交易情况说明				
5.10.2	本期国债期货持仓情况				
5.10.3	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.10.4	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.10.5	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.10.6	本期国债期货投资情况				
5.10.7	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11	股指期货持仓损益				
5.11.1	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.2	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.3	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.4	本期国债期货投资情况				
5.11.5	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.6	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.11.7	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.11.8	本期国债期货投资情况				
5.11.9	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.10	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.11	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.12	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.13	本期国债期货投资情况				
5.11.14	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.15	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.11.16	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.11.17	本期国债期货投资情况				
5.11.18	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.19	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.20	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.21	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.22	本期国债期货投资情况				
5.11.23	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.24	报告期末基金投资的国债期货持仓和公允价值				
5.11.25	报告期末基金投资的国债期货收益				
5.11.26	本期国债期货投资情况				
5.11.27	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				
5.11.28	报告期末基金投资的股指期货持仓损益				
5.11.29	报告期末基金投资的股指期货持仓公允价值				
5.11.30	报告期末基金投资的股指期货收益				
5.11.31	本期国债期货投资情况				
5.11.32	国债期货不属于基金的投资范围,故此项不适用。				

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	929,800.00
2	应收证券清算款	77,492,335.62
3	应收股利	-
4	应收利息	15,754,320.27
5	应收申购款	747,812.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计				94,824,268.76
5.11.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	110008	电气转债	38,634,186.10	1.88	
2	137002	15新钢RE	19,488,000.00	0.96	
3	123001	蓝鼎转债	6,913,478.40	0.34	
4	117014	15大商RE	3,727,080.00	0.18	

	单位:元
报告期前基金份额总额	1,918,447,781.98
报告期前基金份额总额中持有份额	150,868,027.22
报告期内基金份额总额扣除应扣除	137,566,639.64
报告期前基金份额总额扣除应扣除(份额减少以“-”填列)	
报告期期末基金份额总额	1,931,367,169.56

注:①申购份额=申购金额/申购当日基金份额净值	⑤基金管理人运用固有资金投资本基金情况
71 基金管理人持有本基金份额变动情况	
	单位:份
报告期初前基金管理人持有的本基金份额	0.00
报告期内买入/申购总份额	0.00
报告期内卖出/赎回总份额	0.00
报告期末基金管理人持有的本基金份额	0.00
报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

[illegible]

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	600016	民生银行	345,000	3,080,850.00	5.79
2	600000	长江电力	158,000	1,973,420.00	3.71
3	601318	中国平安	59,000	1,890,360.00	3.55
4	600485	信发集团	88,000	1,569,920.00	2.95
5	007454	裕华股份	84,000	1,597,120.00	2.97

6	600967	北方创业	142,000	1,509,460.00	2.87
7	600418	江淮汽车	119,000	1,508,920.00	2.84
8	300267	尔康制药	98,000	1,403,360.00	2.64
9	600000	浦发银行	70,400	1,096,128.00	2.06
10	300271	华宇软件	53,000	1,002,760.00	1.88

[illegible]

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	161,940.32
2	应收非货币款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,491.58
5	应收申购款	20,526,661.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,219,493.01

[illegible]

本期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

1.6 其它应披露事项

8.1 各章节目录

(1) 中国证监会批准利得润利和利得润利基金设立及基金合同设立的相关文件；

(2) 《利得润利和利得润利基金证券投资基金基金合同》；

(3) 《利得润利和利得润利基金证券投资基金基金托管协议》；

(4) 《利得润利和利得润利基金证券投资基金基金招募说明书》；

(5) 基金管理人《基金管理人公告》及《基金从业人员名单》；

(6) 利得润利和利得润利基金证券投资基金基金合同及基金托管协议各章节目录。

8.2 重要提示

基金管理人地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥国际广场5011楼

8.3 联系方式

基金管理人客户服务电话：(86-21)-3110-1730-1730，投资人可拨打该电话，向基金管理人查询。

网站查询：基金管理人网站：<http://www.vedadfund.com> 投资人可登陆该网站，向基金管理人查询。

咨询电话：4007-007-818（免长途话费）或电子邮件：fund-service@vedadfund.com

2012年7月10日

西得利资产管理有限公司
