

国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会;在交易环节严格按照时间优先、价格优先的原则执行指令;如指指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

[illegible]

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	52,397,153.63	6.85
	其中:股票	52,397,153.63	6.85
2	固定收益类资产	725,287,479.38	62.92
	其中:债券	725,287,479.38	62.92
	货币市场基金	-	-
3	公允价值变动	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	269,060,274.43	23.41
6	资产支持证券及结构化产品等金融资产	-	-
7	银行承兑汇票及银行承兑汇票背书合计	96,078,484.64	7.82
8	其他应收款项	14,457,493.08	1.25
9	合计	1,153,721,385.45	100.00
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	-	0.00
B	医药	-	0.00
C	制造业	26,064,000.06	2.27
D	电力、热力、燃气生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	9,621,089.87	0.83
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,467,520.69	0.30
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	317,157.80	0.03
J	金融业	1,144,900.00	0.10
K	房地产业	-	0.00
L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	29,126.10	0.00

[illegible][illegible]

序号	股票名称	数量	公允价值 (元)	公允价值 (元)	公允价值 (元)
1	001127	小盘股份	1,000.00	23,870.00	0.01
2	001041	中国国旅	1,000.00	20,920.00	0.01

5.4 报告期末按投资组合分类的证券投资组合

本基金本报告期末未持有证券投资组合。

5.5 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2016年6月30日

2016年6月30日

[illegible][illegible]
