大成添利宝货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成添利宝货币		
交易代码	000724		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年7月28日		
报告期末基金份额总额	441,070,985.07份		
投资目标	在保持本金安全和资产流动性基础上追求较高的当期收益。		
投资策略	本基金运用利率趋势评估策略、类属配置策略、平均剩余期限配置策略、银行协议存款和大额存单投资策略、流动性管理策略进行投资管理,以实现超越投资基准的投资目标。		
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)		
风险收益特征	本基金为货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种。本基金长期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	兴业银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
下属分级基金的交易代码	000724	000725	000726
报告期末下属分级基金的份额总额	10,912,878.01份	42,846,582.35份	387,311,524.71份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 — 2015年12月31日)		
	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
1. 本期已实现收益	119,196.26	437,286.44	1,690,030.66
2. 本期利润	119,196.26	437,286.44	1,690,030.66
3. 期末基金资产净值	10,912,878.01	42,846,582.35	387,311,524.71

注: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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

大成添利宝A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6953%	0.0031%	0.0882%	0.0000%	0.6071%	0.0031%

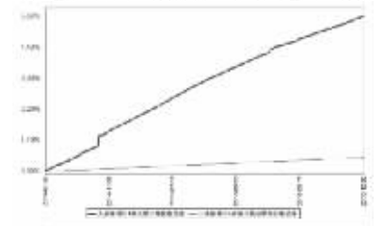
大成添利宝B

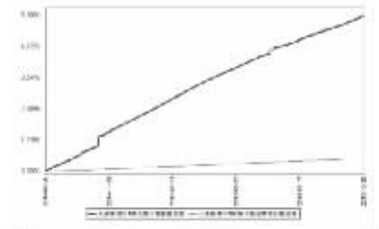
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7569%	0.0031%	0.0882%	0.0000%	0.6687%	0.0031%

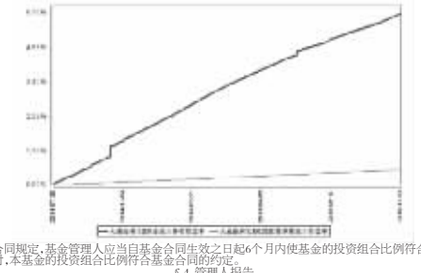
大成添利宝E

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.7218%	0.0031%	0.0882%	0.0000%	0.6336%	0.0031%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较







注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄海峰先生	本基金基金经理	2015年3月21日	-	11年	南开大学经济学学士。2013年7月加入大成基金管理有限公司固定收益部。2013年10月14日起任大成保证金证券内支中国银行货币市场基金基金经理助理。2013年10月28日起大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日起任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理助理。2014年3月18日至2014年12月23日任大成货币市场证券投资基金基金经理助理。2014年6月23日至2014年12月23日任大成丰财宝货币市场基金基金经理助理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理助理。2014年12月24日起,任大成货币市场证券投资基金基金经理及大成丰财宝货币市场基金基金经理。2015年3月21日起,任大成添利宝货币市场基金及大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理。2015年4月29日起,任大成景利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月4日起,任大成益德灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年5月15日起,任大成景源灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

注:1.任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2.证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资决策的说明

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》、《大成添利宝货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成添利宝货币市场基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2015年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在30笔同日反向交易,原因为投资策略需要;主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在4笔同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年四季度,经济基本面依旧不容乐观,经济增长方面,四季度前两个月工业增加值同比增速分别仅为5.6%和6.2%。通胀水平略有上行,但CPI同比涨幅属于可控范畴,相比前期,监管机构继续维持宽松的政策基调,中央银行于10月24日同时进行了降息降准操作,向市场传递了稳定的预期。央行的操作使得银行间回购利率维持低位,四季度隔夜回购利率均值仅为1.86%,7天回购利率仅为2.42%,资金市场持续较为宽松。

在宽松货币政策的指引下,各类货币市场利率持续位于低位。1年期金融债收益率下行约30bp,高等级短期融资券下行约40bp,受新的货币基金监管政策影响,低等级短期融资券下行幅度低于高等级品种,约为15bp。此外,产能过剩行业的短期融资券加点成交较多,除去年底的一段时间,同业存款报价多数为减点。

四季度本基金在投资管理过程中继续贯彻稳健操作的原则,高度重视组合的流动性管理和安全性管理。具体来说,本基金在和持有人积极沟通的基础上,灵活管理组合现金流的到期分布情况,并提高了短融的仓位。并把握半年末等关键时点进行了银行存款和逆回购投资。此外,本基金在一级市场进行了积极的投标,获取了良好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金A类净值收益率为0.6953%,B类净值收益率0.7569%,E类净值收益率0.7218%,期间业绩比较基准收益率为0.0882%。

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2016年一季度,在经济疲弱和市场风险偏好维持低位的背景下,债券市场总体面临的风险较小,本基金将继续维持稳健操作的风格,基于市场状况以及投资人结构变化的判断,合理安排逆回购、存款、短融及金融债的投资比例,以期为持有人获得稳定安全的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	120,117,073.78	26.32
	其中:债券	120,117,073.78	26.32
	资产支持证券	-	0.00
2	买入返售金融资产	159,701,559.55	34.99
	其中:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	174,348,349.58	38.20
4	其他资产	2,238,603.29	0.49
5	合计	456,405,586.20	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	7.88
	其中:买断式回购融资	0.00

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	14,999,872.50	3.40
	其中:买断式回购融资	-	0.00

注:本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本基金合同约定:"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	78.00	3.40
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30天(含)-60天	2.27	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
3	60天(含)-90天	4.54	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90天(含)-180天	5.69	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180天(含)-397天(含)	12.47	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	0.00
	合计	102.97	3.40

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	20,040,869.75	4.54
	其中:政策性金融债	20,040,869.75	4.54
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	100,076,204.03	22.69
6	中期票据	-	0.00
7	同业存单	-	0.00
8	其他	-	0.00
9	合计	120,117,073.78	27.23
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	0.00

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011548003	15中节能SCP003	200,000	19,986,300.85	4.53
2	011533015	15五矿SCP015	150,000	14,993,039.07	3.40
3	041560030	15闽稀土CP001	100,000	10,061,903.08	2.28
4	150307	15进出07	100,000	10,025,794.90	2.27
5	041555008	15中山兴中CP001	100,000	10,023,178.65	2.27
6	041551030	15大宝能源CP001	100,000	10,020,479.92	2.27
7	150403	15农发03	100,000	10,015,074.85	2.27
8	071530007	15财通证券CP007	100,000	9,999,571.59	2.27
9	011599819	15云能投SCP006	100,000	9,996,507.11	2.27
10	011598135	15国投SCP011	100,000	9,995,369.94	2.27

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1226%
报告期内偏离度的最低值	0.0354%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0681%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法估值,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00 元。

5.8.2 本报告期内不存在基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

5.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期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。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,227,068.55
4	应收申购款	11,534.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,238,603.29

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	大成添利宝A	大成添利宝B	大成添利宝E
报告期期初基金份额总额	26,752,848.73	67,424,049.27	129,153,183.27
报告期期间基金总申购份额	8,487,052.96	507,186.08	917,125,897.50
减:报告期期间基金总赎回份额	24,327,023.68	25,084,653.00	658,967,556.06
报告期期末基金份额总额	10,912,878.01	42,846,582.35	387,311,524.71

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 基金管理人子公司-大成创新资本管理有限公司持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初持有的本基金份额	185,242.73
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	185,991.53
报告期期末持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00%

注:期间收益再投资份额为748.80份。

8.2 基金管理人子公司-大成创新资本管理有限公司运用固有资金投资本基金交易明细

无。

8.3 基金管理人于2015年10月15日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会第十一次会议审议通过,杨春明先生不再担任公司副总经理职务。

8.4 基金管理人分别于2015年10月16日、10月30日发布了《大成基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经大成基金管理有限公司第六届董事会十次会议审议通过,周立新先生、温志敏先生担任公司副总经理职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立大成添利宝货币市场基金的文件;

2、《大成添利宝货币市场基金基金合同》;

3、《大成添利宝货币市场基金托管协议》;

4、大成基金管理有限公司批准文件、营业执照、公司章程;

5、本报告期内在指定报刊上披露的各种公告原稿。

9.2 存放地点

本季度报告存放在本基金管理人和托管人的办公住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,或登录本基金管理人网站http://www.dcfund.com.cn进行查阅。

大成基金管理有限公司
2016年1月20日

深证成长40交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	大成深证成长40ETF		
场内简称	深成长		
交易代码	159906		
基金运作方式	交易型开放式		
基金合同生效日	2010年12月21日		
报告期末基金份额总额	193,639,725.00份		
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求与标的指数相似的投资回报。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。		
业绩比较基准	深证成长40价格指数		
风险收益特征	本基金属股票基金,预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。		
基金管理人	大成基金管理有限公司		
基金托管人	中国农业银行股份有限公司		

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 — 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	9,340,237.10
2.本期利润	39,008,699.04
3.加权平均基金份额本期利润	0.1874
4.期末基金资产净值	219,251,775.18
5.期末基金份额净值	1.132

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人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。

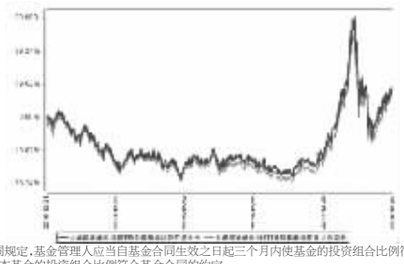
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	19.16%	1.72%	24.73%	1.90%	-5.57%	-0.18%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张钟玉女士	本基金基金经理	2015年5月23日	-	5年	会计学硕士。2010年7月加入大成基金管理有限公司,历任研究部研究员、数量投资部数量分析师。2013年3月25日至2015年1月14日担任大成优选股票型证券投资基金(LOF)和大成沪深300指数证券投资基金基金经理助理。2015年2月28日至2015年7月21日任大成核心双动力股票型证券投资基金基金经理。2015年7月22日起任大成核心双动力混合型证券投资基金基金经理。2015年5月23日起任深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金及大成中证500深市交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2015年8月26日起担任大成沪深300指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国

注:1、任职日期、离任日期为本基金管理人作出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资决策的说明

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》、《大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,在基金管理运作中,大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定,本基金没有发生重大违法违规行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定,公司制订了《大成基金管理有限公司公平交易制度》、《大成基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司旗下投资组合严格按照制度的规定,参与股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,内容包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等与投资管理活动相关的各个环节。研究部负责提供投资研究支持,投资部门负责投资决策,交易管理部负责实施交易并实时监控,监察稽核部负责事前监督、事中检查和事后稽核,风险管理部负责对交易情况进行合理性分析,通过多部门的协作互控,保证了公平交易的可操作、可稽核和可持续。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司风险管理部定期对公司旗下所有投资组合间同向交易、反向交易等可能存在异常交易的行为进行分析。2015年4季度公司旗下主动投资组合间股票交易存在30笔同日反向交易,原因为投资策略需要;主动型投资组合与指数型投资组合之间或指数型投资组合之间存在股票同日反向交易,但不存在参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该股当日成交量5%的交易情形;投资组合间债券交易存在4笔同日反向交易;投资组合间相邻交易日反向交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明该类交易不对市场产生重大影响,无异常;投资组合间虽然存在同向交易行为,但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A股市场继三季度大幅下跌后,本季度温和反弹。受益于经济转型的新兴产业依然是市场热点,成长股、概念股成为反弹先锋,创业板指四季度上涨30.3%。但国内经济仍然增长乏力,在人民币持续贬值的压力下,货币宽松政策也低于市场预期,周期股和监管股仅有小幅估值修复,推动沪深300指数上涨16.5%。

报告期内本基金基本保持高仓位运作,严格根据标的指数成分股调整以及权重的变化及时调整投资组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末,本基金份额资产净值为1.132元,本报告期基金份额净值增长率为19.16%,同期业绩比较基准收益率为24.73%,低于业绩比较基准的表现。

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2016年,美国进入加息周期,新兴市场面临资本外流风险,中国货币宽松政策的操作空间减小。虽然目前各主要指数距2015年6月高点已大幅回调,但创业、中小板估值仍偏高,未来市场波动会加大。经济复苏的时点还难以判断,但经济转型的大方向已经确定,有业绩支持的龙头成长股和受益于改革政策的蓝筹股是更稳健的投资标的。

组合管理上,我们将严格按照基金合同的相关约定,紧密跟踪标的指数,按照标的指数成分股组成及其权重的变化调整投资组合,努力实现跟踪误差的最小化。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	216,738,697.48	97.34
	其中:股票	216,738,697.48	97.34
2	固定收益投资	306,800.00	0.14
	其中:债券	306,800.00	0.14
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	5,606,522.73	2.52
7	其他资产	20,164.07	0.01
8	合计	222,672,184.28	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	118,707,298.96	54.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	5,086,451.92	2.32
F	批发和零售业	4,958,394.00	2.26
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,311,074.72	24.32
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	3,548,838.58	1.62
L	租赁和商务服务业	6,121,257.72	2.79
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	15,029,151.22	6.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	9,976,230.36	4.55
S	综合	-	0.00
	合计	216,738,697.48	98.83

注:含提前买入的指数备选成分股。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未有积极投资。

5.3 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

5.3.1 报告期末指数投资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	300059	东方财富	318,853	16,589,921.59	7.57
2	002450	康得新	389,156	14,826,843.60	6.76
3	300104	乐视网	243,602	14,323,797.60	6.53
4	002415	海康威视	397,709	13,677,212.51	6.24
5	000625	长安汽车	607,000	10,300,790.00	4.70
6	300027	华谊兄弟	240,507	9,976,230.36	4.55
7	300070	碧水源	174,724	9,045,461.48	4.13
8	002241	歌尔声学	248,302	8,591,249.20	3.92
9	000982	中银绒业	1,773,374	8,228,455.36	3.75
10	300017	网宿科技	135,362	8,120,366.38	3.70

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未有积极投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	0.00
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中:政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	306,800.00	0.14
8	同业存单	-	0.00
9	其他	-	0.00
10	合计	306,800.00	0.14

5.5 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

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	123001	蓝标转债	3,068	306,800.00	0.14

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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	300059	东方财富	318,853	16,589,921.59	7.57
2	002450	康得新	389,156	14,826,843.60	6.76
3	300104	乐视网	243,602	14,323,797.60	6.53
4	002415	海康威视	397,709	13,677,212.51	6.24
5	000625	长安汽车	607,000	10,300,790.00	4.70
6	300027	华谊兄弟	240,507	9,976,230.36	4.55
7	300070	碧水源	174,724	9,045,461.48	4.13
8	002241	歌尔声学	248,302	8,591,249.20	3.92
9	000982	中银绒业	1,773,374	8,228,455.36	3.75
10	300017	网宿科技	135,362	8,120,366.38	3.70

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

本基金投资的前十名证券之一中银绒业,于2015年1月29日收到中国证券监督管理委员会下发的《调查通知书》;公司因涉嫌信息披露违法违规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会于2014年10月23日对公司立案调查。本基金认为,对中银绒业的立案调查不会对其投资价值构成实质性负面影响。

5.12.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	86,944.24
2	应收证券清算款	3,726,780.66
3	应收股利	-
4	应收利息	2,622.84
5	应收申购款	128,269.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,944,617.28

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 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 | 流通受限部分的公允