宝盈资源优选混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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	宝盈资源优选混合
基金主代码	213008
交易代码	213008
前端交易代码	213008
后端交易代码	213908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月15日
报告期末基金份额总额	3,565,885,731.68份
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,处于稀缺状态的资源占现其强大的经济价值,相关上市公司体现出较好的投资价值。 本基金根据研究部的估值模型,优选各个行业中具有资源优势的上市公司,建立股票池。在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续增值,并力争创造超越业绩基准的主动管理回报。
投资策略	本基金将中长期持有具有资源优势的股票为主的股票投资组合,并注重资产在各相关行业的配置,适当进行时机选择。采用"自上而下"进行资产配置和行业配置、"自下而上"精选个股的积极投资策略。 1.资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况,市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2.股票投资策略 本基金将把握资源的价值变化规律,对各类资源的现状和发展进行分析判断,及时适当调整各类资源行业的配置比例,重点投资于各类资源行业中的优势企业,分享资源长期价值提升所带来的投资收益。 在个股选择层面,本基金以净资产收益率、预期PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据,通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。 3.债券及短期金融工具投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。 4.权证投资策略 本基金在进行权证投资时将在严格控制风险的前提下谋取最大的收益,以不改变投资组合的风险收益特征首要条件,运用有关数量模型进行估值和风险评估,谨慎投资。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	-157,641,752.15
2.本期利润	2,325,251,379.84
3.加权平均基金份额本期利润	0.6262
4.期末基金资产净值	7,803,272,504.48
5.期末基金份额净值	2.1883

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 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	39.32%	2.33%	12.84%	1.26%	26.48%	1.07%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本基金在2008年4月15日由原封闭式基金转换成立。
2.按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§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		
彭敢	本基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈策略增长混合型证券投资基金、宝盈鑫丰创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;总经理助理,投资部总监	2010年11月5日	-	14年	彭敢先生,金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部,中国籍,证券投资基金从业人员资格。

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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中以公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第四季度A股市场表现较为稳健的反弹走势,上证指数、沪深300、深成指和创业板均出现稳步上扬,分别上涨15.93%、16.49%、27.35%和28.12%,本季度指数走势让市场重新恢复活力,成交量也逐渐企稳。本基金在四季度实现收益39.32%,为持有人获得较好的投资收益。

本基金管理人认为,本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑,虽然从宏观经济的增速来看,中国经济仍然在持续的下滑调整过程中,政府能要通过各种货币政策工具操作来降低实体经济利率,同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级;从整体来看,政府依然能有决心实现稳定的经济增长,同时也会面支持发展新兴产业,无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展,都能体现国家对经济结构转型升级的决心。在前四季度,本基金管理人一直以代表经济增长转型的战略性新兴产业个股作为重点投资标的,虽然结果来看投资收益不能算顶级,但基本能按照本基金管理人的投资理念来执行,虽然经历了三季度市场系统性下跌,管理人也未能幸免于下跌,但在较低位置主动参与了反弹,并取得了不错的效果。

2015年四季度A股经历了三季度剧烈震荡后逐渐企稳,政府通过大量救市资金入市和上市公司限制减持等措施让市场取得了阶段性稳定市场效果;从资金面来分析,从改革转型叠加杠杆资金市场导致过热上涨的市场出现了大幅调整,较多的杠杆资金在三季度加速撤离市场,但是在四季度出现了稳定,基本表现为存量资金在市场博弈态势;从公司基本面来分析,三季度大多数上市公司并未出现季报业绩低于预期的情况,甚至不少新兴成长公司三季报业绩大幅超预期,也成为市场新的龙头;从过往历史来看,基金管理人一直坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来操作,在板块选择上坚持选择与过往市场不同的新的投资方向和新成长主题,虽然由此也丧失了一些投资机会,也未能将提前布局的优质成长股收益最大化等,但从整体结果来看,较为理想。季度末主要持仓集中在医药、军工、新能源、TMT、农业、环保等方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是39.32%,同期业绩比较基准收益率是12.84%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	7,205,095,264.55	90.95
	其中:股票	7,205,095,264.55	90.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	349,305,927.10	4.41
	其中:债券	349,305,927.10	4.41
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	296,000,742.12	3.74
8	其他资产	71,369,165.44	0.90
9	合计	7,921,771,099.21	100.00

5.2 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	471,798,619.96	6.05
B	采矿业	67,477,699.38	0.86
C	制造业	4,644,222,509.98	59.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,510,000.00	0.34
E	建筑业	60,245,991.25	0.77
F	批发和零售业	1,548.50	0.00
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	1,298,919,306.45	16.65
J	金融业	105,112,195.45	1.35
K	房地产业	106,333,502.94	1.36
L	租赁和商务服务业	132,197,830.48	1.69
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	189,331,695.00	2.43
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	102,944,365.16	1.32
S	综合	-	-
	合计	7,205,095,264.55	92.33

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

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	002522	浙江众成	26,545,200	491,882,556.00	6.30
2	300252	金信诺	11,021,389	445,264,115.60	5.71
3	002023	海特高新	18,921,152	347,013,927.68	4.45
4	603456	九洲药业	4,666,405	323,232,475.15	4.14
5	002368	太极股份	4,684,427	314,325,051.70	4.03
6	300170	汉得信息	13,900,000	275,915,000.00	3.54
7	002773	康弘药业	3,148,247	258,785,903.40	3.32
8	002373	千方科技	4,840,666	221,460,469.50	2.84
9	300094	国联水产	8,634,734	217,595,296.80	2.79
10	002215	诺 普 信	10,417,436	199,806,422.48	2.56

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	349,305,927.10	4.48
	其中:政策性金融债	349,305,927.10	4.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	349,305,927.10	4.48

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	018001	国开1301	3,492,710	349,305,927.10	4.48

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内曾受到公开谴责、处罚。

2015年1月17日,浙江九洲药业股份有限公司(以下简称"公司")位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故,造成4名工人受伤,经抢救无效死亡。事故发生后,公司立即启动突发事件应急处置预案,并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内,未对公司生产经营造成重大影响,也未对公司的经营业绩产生较大影响。2015年4月22日,公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书,认定该事故为一般生产安全责任事故,给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司统计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在事故发生后及处罚决定下达后未做减持。

2015年12月21日,深交所发布《关于对湛江国联水产开发股份有限公司及相关当事人给予通报批评的决定》。湛江国联水产开发股份有限公司(以下简称"国联水产")及相关当事人存在以下违规行为:国联水产披露的2014年度业绩快报的财务数据与2014年年报披露的财务数据相比,净利润相差较大,且业绩快报修正公告的披露时间严重滞后。国联水产董事长李忠、董事兼总经理陈汉、董事兼副总经理、时任财务总监吴丽雪未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,上述行为均违反了《创业板股票上市规则(2014年修订)》相关规定,相关当事人对上市公司的违规行为负有重要责任。鉴于上述违规事实和情节,深交所对上市公司及相关当事人做出通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案,向社会公布。此次事件短期内对上市公司的上一年度经营业绩产生了影响,但对当季不产生影响,并且从长期看,不影响公司的后续发展和战略规划。我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在通报批评决定下达后未做减持。

5.11.2 本基金所投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,792,085.71
2	应收证券清算款	39,999,983.76
3	应收股利	-
4	应收利息	20,215,633.90
5	应收申购款	7,361,462.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,369,165.44

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,785,700,468.56
报告期期间基金总申购份额	596,784,082.84
减:报告期期间基金总赎回份额	816,598,819.72
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,565,885,731.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,499,697.49
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,499,697.49
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.15

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期内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
本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批复鸿飞基金的名称变更为宝盈资源优选股票型证券投资基金的文件。
根据《关于宝盈资源优选股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈资源优选股票型证券投资基金名称变更为宝盈资源优选混合型证券投资基金。
《宝盈资源优选混合型证券投资基金基金合同》。
《宝盈资源优选混合型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层
基金托管人办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

9.3 查阅方式
上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2016年1月20日

宝盈中证100指数增强型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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	宝盈中证100指数增强
基金主代码	213010
交易代码	213010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月8日
报告期末基金份额总额	71,169,736.92份
投资目标	在基金合同规定的范围内,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,结合增强收益的主动投资,力争取得基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,基金总体投资业绩超越中证100指数的表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分采用完全复制法,按照成份股在中证100指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。本基金对主动投资部分实行双向积极配置策略。采用利率预期、收益率曲线变动分析、信用度分析、收益率利差分析、相对价值评估等债券投资策略。采用市场公认的定价技术,适当参与金融衍生产品的投资。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金投资于中证100指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产的80%,预期风险收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金,属于较高风险收益预期的证券投资基金产品。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	-1,997,650.33
2.本期利润	14,279,304.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.1662
4.期末基金资产净值	79,770,378.93
5.期末基金份额净值	1.121

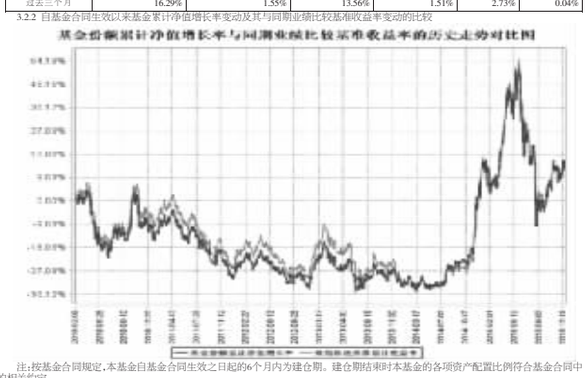
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	16.29%	1.55%	13.56%	1.51%	2.73%	0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率与及与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§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		
盖俊龙	本基金基金经理、宝盈泛沿海区域增长混合型证券投资基金基金经理、宝盈新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、宝盈鑫锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年7月10日	-	10年	盖俊龙先生,经济学硕士。2005年8月至2011年8月,在长城基金管理有限公司历任金融工程研究员、行业研究员。2011年6月加入宝盈基金管理有限公司,历任研究部核心研究员、专户投资部投资经理。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。
郭晓	本基金基金经理	2015年8月27日	-	3年	郭晓先生,经济学硕士。2012年7月起加入宝盈基金管理有限公司任金融工程部研究员,负责数量化选股、衍生品投资等量化策略研究。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中以公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面,由于我国经济增长模式的转变和经济结构的转型,由于劳动力增速的趋势性下行,经济增速降档成为新常态,预计2015年全年我国GDP同比增速为6.9%。2015年四季度CPI同比涨幅继续处于低位水平小幅震荡,而PPI同比涨幅则继续处于负值,采购经理指数PMI徘徊在50的荣枯线以下,各项数据显示经济增长仍然疲弱。四季度以来,证券市场在前期两次股灾的大幅下跌之后出现了较大幅度的反弹,市场情绪逐步回归理性,其中市值较小、前期跌幅较大的板块反弹幅度更大。

报告期内,本基金的股票仓位维持在较高位水平。结构上而言,以复制中证100 指数权重为主,此外在新兴成长行业中精选个股,进行增强投资。中证100指数在12月进行了最近一次成分股调整,东方财富、乐视网等新兴产业中的成长型龙头企业纳入指数成分股,预示着在经济结构转型、产业升级背景下,中证100指数的代表性也日然地与时俱进。本基金四季度的净值增长率是16.29%,整体表现略好于业绩比较基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是16.29%,同期业绩比较基准收益率是13.56%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	73,534,442.13	78.81
	其中:股票	73,534,442.13	78.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,009,000.00	5.37
	其中:债券	5,009,000.00	5.37
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	10,000,000.00	10.72
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,065,947.16	3.29
8	其他资产	1,697,039.70	1.82
9	合计	93,306,428.99	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	18,685.00	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	8,250.00	0.01
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,935.00	0.03

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	601318	中国平安	131,190	4,722,840.00	5.92
2	600016	民生银行	358,300	3,454,012.00	4.33
3	601166	兴业银行	161,900	2,763,633.00	3.46
4	000002	万 科A	100,200	2,447,886.00	3.07
5	600036	招商银行	125,100	2,250,549.00	2.82
6	600000	浦发银行	113,000	2,064,510.00	2.59
7	600030	中信证券	95,500	1,847,925.00	2.32
8	601328	交通银行	285,800	1,840,552.00	2.31
9	601398	工商银行	366,900	1,680,402.00	2.11
10	600837	海通证券	98,363	1,556,102.66	1.95

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

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	002781	奇信股份	500	18,685.00	0.02
2	002777	久远银海	500	8,250.00	0.01

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	5,009,000.00	6.28
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	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,009,000.00	6.28

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	019515	15国债15	50,000	5,009,000.00	6.28

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂不参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资的前十名证券发行主体中除中信证券、海通证券外没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2015年1月18日,中信证券公告:"因存在为到期融资融券合约展期的问题(根据相关规定,融资融券合约期限最长为6个月),公司被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。"

2015年1月19日,海通证券公告:"因存在违规为到期融资融券合约展期问题,受到暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。"

2015年8月24日,海通证券股份有限公司收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(津证调查字[2015011]号)。因海通证券涉嫌未按规定审查、了解客户身份等违法违规行为,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对海通证券进行立案调查。2015年9月10日,海通证券股份有限公司因涉嫌未按规定审查、了解客户真实身份违法违规案,收到中国证券监督管理委员会行政处罚事先告知书(处罚字[2015]73号),对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得28,653,000元,并处以85,959,000元罚款。

中信证券、海通证券为本基金的指数成分股,本基金管理人主要按照上述成分股所占的权重进行相应配置,符合相关法规和基金投资策略的要求。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	193,441.30
2	应收证券清算款	1,429,038.50
3	应收股利	-
4	应收利息	58,878.31
5	应收申购款	15,681.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,697,039.70

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明
报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	94,269,788.59
报告期期间基金总申购份额	31,399,637.83
减:报告期期间基金总赎回份额	54,499,689.50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	71,169,736.92

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内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
本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备