

(上接B1版)

3、基金财产的清算。
 (1) 基金财产清算小组:自出现“基金合同终止事由”之日起30个工作日内成立清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组在基金合同的监督下进行基金清算。
 (2) 基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指派的人员组成。基金财产清算小组可以聘任必要的工作人员。
 (3) 基金财产清算组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的申请和公告。

(4) 基金财产清算的期限:自出现“基金合同终止事由”之日起30个工作日内完成。

1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金;

2)对基金财产进行清理和确认;

3)对基金财产进行估价和变现;

4)制作清算报告;

5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

6)将基金财产清算报告报中国证监会备案并公告;

7)对基金剩余财产进行分配;

(5)基金财产清算的期限为60个工作日。

4、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产清算财产中支付。

5、基金财产清算的分配方案

依据基金财产清算方案分配基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用,交纳所欠税款并清偿基金债务后,根据基金份额持有人持有的基金份额比例分配。

6、基金财产清算的公告

清算过程中的重大事项须及时公告。基金财产清算报告经会计师事务所审计,并由律师事务所出具法律意见书后,报中国证监会备案。

7、基金财产清算报告书与基金财产清算报告书的公告

基金财产清算报告书与基金财产清算报告书在公告后7个工作日内由基金管理人公告。

8、基金财产清算的期限

基金财产清算的期限为60个工作日。

基金总值	-应付赎回款	7,362.74
债券投资	-应付管理人报酬	25,039.96
资产支持证券投资	-应付托管费	5,508.80
贵金属投资	-应付机构服务费	-
衍生金融资产	-应付交易费用	12,960.97
买入返售金融资产	-应付交易费用	-
应收证券清算款	-应付利息	-
应收利息	-应付利息	-
18,183.42	应付赎回款	-
应收股利	-应付所得税负债	-
应收申购款	3,789.54 其他负债	264,531.04
递延所得税资产	-负债合计	315,403.51
其他资产	-所有者权益:	-
买入返售基金	实收基金	21,816,278.64
未分配利润	-未分配利润	-359,392.40
资产总计	所有者权益合计	21,456,886.24
21,772,289.75	负债和所有者权益总计	21,772,289.75

H 住行和租赁业	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	127,864.00	0.6
J 金融业	-	-
K 房地产业	-	-
L 贸易、餐饮及服务	-	-
M 科学研究、技术服务业	11,160.00	0.05
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-
O 固定资产、修理和其他服务业	-	-
P 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
R 纳税	-	-
合计	6,065,543.40	28.28

2. 截至2016年1月25日,本基金投资的前十名股票中不存在投资于超出基金合同规定备选股票池的情形。		
3. 其他资产构成		
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	35,944.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,185.42
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	57,918.98

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至2016年1月25日,本基金未持有可转换债券。

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至2016年1月25日,本基金未投资前十名的股票,即报告期末前十名的股票中不存在流通受限情况。

6. 投资组合报告附注中涉及的其他文字描述详见

第七节“五、买入、卖出股票、债券、基金情况”。

七、重大事件揭示

本基金在报告期内未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

八、基金管理人承诺

本基金管理人员在本基金上场交易后履行管理人职责并承担法律责任。

九、报告期末基金资产组合情况

1. 报告期末基金资产组合明细

1) 根据投资比例不同行业分类的股权投资组合

截至2016年1月25日,本基金未投资股权投资。

2) 报告期末按行业分类的沪深股通投资股票投资组合

截至2016年1月25日,本基金未通过沪深股通机制投资股票。

(三) 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股票投资明细

1) 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股票投资明细

2) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资组合

3) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资组合

4) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名保险投资组合

5) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名货币市场基金

6) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名其他投资组合

7) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名存出保证金

8) 其他资产

9) 合计

10) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名应收款项

11) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名买入返售金融资产

12) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

13) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资性房地产

14) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资性金融资产

15) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

16) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

17) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

18) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

19) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

20) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

21) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

22) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

23) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

24) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

25) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

26) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

27) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

28) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

29) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

30) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

31) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

32) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

33) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

34) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

35) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

36) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

37) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

38) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

39) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

40) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

41) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

42) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

43) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

44) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

45) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

46) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

47) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

48) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

49) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

50) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

51) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

52) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

53) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

54) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

55) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

56) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

57) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

58) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

59) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

60) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

61) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

62) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

63) 报告期末按资产净值占基金资产净值比例大小排序的前五名长期股权投资

64) 报告期末