

基金管理人: 兴业全球基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 送出日期:2016年3月25日

1.1 重要提示 基金管理人的董事会、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 个别及金币总从即重要。强等使让个程度的表现种个任任监证记载。该专注的还发现人资源。并为身外等的典本性。如即让村立起往步身生一个别及金币的设施性,在单位使用它是一些一个生产,让他立家都签字的原。并由董林长安设在中的财务指标。净值表现。利润分配情况、财务计划的是设施自然宣动实施。但是被自然宣动实施。但是被自然宣动实施。 基金管理人承诺以该定信用,勤勉等的的原则管理和运用基金管产。但不能让基金产定原制。 基金管理人承诺以该定信用,勤勉等的的原则管理和运用基金管产。但不能让基金产定原制。 基金管理人承诺以该定信用,勤勉等的的原则管理和运用基金管产。但不能让基金产定原制。

本报告期自2015年01月01日起至12月31日止。 本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

	82 基金简介
2.1 基金基本情况	
基金简称	兴全社会责任混合
场内简称	-
基金主代码	340007
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月30日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
Secret Alex 1 day 4 of the 10 day	**

2.2 基金产品说明	III权示至证分权贝器业 支史内 六主社云贝II化口至证分权贝器业 。
投資目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、逾德责任等方面的履行。
起液瘤略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,将定性与定量研究相结合,在宏观与微观 层面对各类数产的价值增长能力展开综合评估。动态优化资产配置,在模据行业所处生命周期,景气 周期,行业盈利与发现检验图末途也要和能大投好,持续发展的开始的行业分基础上、采用"兴企 双层行业筛选注"进行优化调整。采用"兴企社会贵田四维选股模型"精态股票。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证图债指数
风险收益特征	较高风险、较高收益

%×中证国债指数 "。			
2.3 基金管理人和基	金托管人		
J	旭	基金管理人	基金托管人
名称		兴业全球基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
	姓名	将绕莲	田青
信息披露负责人 联系电话	联系电话	(21-2)398888	010-67595096
	电子邮箱	fengsk@xyfunds.com.en	timqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	•	4006780099,021-38824536	010 -67595096
传真		021-20398858 010-66275853	
2.4信息披露方式			
White to A for stoleral constraint	mar 1 - marchines need 1		

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.50% 1.716 1.100 注:1.上述財务指标采用的计算公式,详见中国证券监督管理委员会发布的(证券投资基金信息披露编根规则第1号<主要财务指标的计算及披露》、(证券投资基金会计核算业务指引)等相关进规。 2.本制C支票的企能活基金本期利息收入,投资收益,并他收入(不含公允价值变动收益) 社除相关费用后的余额。本期补润为本期已实现收益加上本期公允价值变效收益,期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润与工资建设的数据数。 3.1.上基本业绩指标不包括有人认购成交易基金的各项费用(例如:开放式基金的中购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计人费用后实所收益水平要低于所列数字。

	份额净值增长率①	份额净值增长率标 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	0-3	2-4
过去三个月	21.31%	2.01%	13.77%	1.34%	7.54%	0.67%
过去六个月	-0.38%	3.00%	-11.83%	2.10%	11.47%	0.90%
过去一年	68.18%	2.78%	8.02%	1.95%	60.16%	0.83%
过去三年	128.87%	1.93%	44.92%	1.40%	83.95%	0.53%
过去五年	90.12%	1.65%	23.56%	1.26%	66.56%	0.39%
基金合同生效起至今	228.86%	1.59%	13.39%	1.45%	215.47%	0.14%

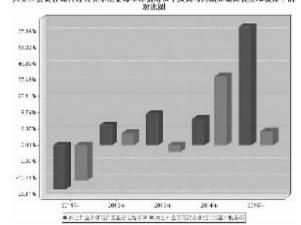
Return $t=80\%\times$ (沪深300指数 t / 沪深300指数 t-1 -1) $+20\%\times$ (中证国债指数 t / 中证国债指数 t-1 -1) Benchmark $t=(1+Return\ t)\times(1+Benchmark\ t-1)-1$

其中,t=1,2,3,··· T,T表示时间截至日。 2、自2015年9月21日起,本基金业绩比较基准由 "80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数" 变更为 "80%×沪深300指数+20%

201.22%											1
312.14%				++	1111111			-	1	+	1
21821%				-					+		#
334.7%				Н							16
65.7%	-			H			-		-	1	1
78:25				-					+	+)	-14
17.11%										1	1
00.00%				\n.			4	بإحيا	Nage /	~	
59.22%		MIN	M	Y	W	-	1	1000			M.
0.156	~ /	Am	20							pol	7
39.33%	J.M.				~		~~	S. March	1		
0.000004											

任:1.4厘组表更明核效能确定到2019年12月31日。 2.龙原(父金龙伊托信金钟亚传仪载金鳌金合同)的规定,本基金建仓周为2008年4月30日至2008年10月29日。建仓即结束时本基金 股产完配批协府合本基金合同规定的比例原制及投资组合的比例范围。 3.但2016年3月21日总、基金金维比较混乱:"800x 中信标誉300指数 2.0% 中信标普图统指数" 变更为 "80% x 产深300指数 4.20%

关全社会責任報合过去五年基全每年净貨增长本及其与同期业額比较基準收益率的 为比例



姓名	即各	任本基金的	基金经理(助理)期限	证券从业年限	说明
(1)	10139	任职日期	高任日期	IIESFACIET-RE	
傳動博	副总经理、研究部总 监、金融工程与专题 研究部总监、本基金 基金经理	2009年1月16日	-	22年	经济学硕士,历任上海财经大学经济管理 训师,申银万国证券投份有限公司企业融 解延理,东方证券投份有限公司企业的 负责人,研究所省席等路师;汇游高基金 理有限公司基金管理部制总监。兴全绿色设 商限公司基金管理部制总监。兴全绿色投 混合整证券投资基金 (LOF)基金经理。 经知时理。

种吗决定之口。 "证券从业年限"按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金宣作重频宇信ة仍如识明 本报告期人来基金管理人严强循了证券投资基金法,没其各项实施细则《兴全社全房压混合专证券投资基金基金合同》和其他相 运转决基础的规定。本着被求信用,勤勉尽界,混信于市场。现信于社会的原则管重应证用基金资产,为基金份额持有,其求最大有丝。管理 于2015年8月3日收到上海证盖局发出的《关于对火业全球基金管理有限公司采取资令改正措施的决定》,要求对人员行方和异常公务加 清省管理。管理人上房极整弦、本报告期内、基金投资管理符合有关法版和基金合同的规定。无法选法规、未提行基金合同承诺或请考基金份

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

43.1公平交易的照货和使用方法 本基金管理人制定了(兴业全球基金管理有限公司公平交易制度),并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、 易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范、从而达到保证本基金管理人管理的不同投

4.3.公平交易機能的执行标记 未报告期內,本集金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定。从 报按权。研究分析、投资法策、交易执行。业绩评估等环节严格把关、确保各投资组合之间得到公平对待。保护投资者的合法权益。 4.3.3 罪答交易行为的专项证明 未收告期內,必是更加能較宏不公平交易和利益输送的异常交易情况。

风险出发。本基金当当增加了一些估值相对较低的解兴成长霰等。控制了争值的波动幅度。回侧整个期间,基金净值相对业纳比较基准获得了较为明显的信赖收益。
4.2 报告期间基金砂油港港现
4.2 报告期间基金砂油港港现
4.8 报告单位继长率8.18%。同期业制计较基单8.02%。
4.5 智雅人对求型经济。证券市场及行业生势的测照模型
展型2016年,实体经济仍然需要通过主库存去产能来改善投资效率。从整体更优质的上市公司库本来看。这一过程仍然在艰难前行之中,企业盈利政绩的单看到。在英国加加自约得下,该金加近一步发发空间十分有限,需需摄成边址纷点。注册制实施、股票设计设计分值。
自由市场总标价值不标。在此大岸联下,2.016年期则放益率成定2016年有较大幅度的操作。整核改策被起于储衡。
在当前点位价值信件下,在中企业的经验系统和影和影创转传统是,越区现价价价的资格。而得增益发现例人自互制的结束,过去几年租放
无均衡本权。尽但解析等以为维、大量纷全可需要提高效率来及得市场价值。例如物流、汽车产业建、线下消费及损的重构等符合经济结构。
建筑方式,在从市场间的作用。在外市场上被,现在分面,在处地域的发生的发生,就是使用的影响,但有一个重要将根据被大速被未被被发生持续被逐步发展,但一个重定将根据被大速被大速被

46 管理人内部有关本基金的监察辖核工作情况 本基金管理人通过以下工作的开展,有力地保证了本基金整体运作的合法合规,从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当

罗八即日在XXXX。 ,海时风险监控,通过风控系统对本基金的运作进行实时监控,每日撰写监控日志,在此基础上每周撰写信息周报,对本基金遵守风控指标的情况进行汇息,分析和提示。

的情况进行汇总、分析和提示。 2、加强事后人工分析,并定期撰写风险管理报告。除系统控制外,公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风腔指标进行了事后人工计

兴全社会责任混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

7.4.8.2.2 基金托管费

6--4.8 管理人对报告期内基金和间分配情况的说明 根据《基金法》、(兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内未进行利润分配,符合本基金 各同的相关规则 6合同的相大规定。 4.9报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

5.1 报告期内本基金社管入遗理守信馆况声明 本报告期,日暗驻投程行股份有股公司在本金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金台同、托管协议和其他有关规定、不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽肃地履行了基金托管人应尽的义务。 5.2 托管人分报告期内本基金投资后管规对告。净值计算、利润分配等情况的原则 本报尽用。允任管人按照原本有关规定、基金合用、任管协议和其他传关规定、决本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行 了认真的复核。对本基金的投资运作方而进行了监管。未发现基金管理人有指责基金份额持有人利益的行为。 组织由此一张文化之中实验的公司。

报告期内, 产品金木头施利用分配。 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实, 准确和完整发表意见

	§ 6 审计报告
财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	华马威华振市字第1600186号
备注	投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文

会计主体:兴全社会责任混合型证券投资基金 报告截止日: 2015年12月31日

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产;			
银行存款		158,465,465.06	45,786,218.7
结算备付金		18,079,093.47	6,716,973.0
存出保证金		3,773,747.21	1,155,849.4
交易性金融资产		6,907,871,488.14	4,138,423,657.7
其中:股票投资		6,607,246,488.14	3,938,368,657.7
基金投资		-	-
债券投资		300,625,000.00	200,055,000.0
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		=	-
衍生金融资产		_	-
买人返售金融资产		-	
应收证券清算款		42,275,933.64	86,097,004.1
应收利息		6,960,292.31	6,938,311.5
应收股利		-	
应收申购款		3,169,923.89	1,582,918.4
迪廷所得税资产		-	
其他资产		_	-
资产总计		7,140,595,943.72	4,286,700,932.9
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负债。			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债		-	
卖出回购金融资产款		=	
应付证券清算款		-	
应付赎回款		40,985,060.61	50,674,092.4
应付管理人报酬		8,987,296.62	5,851,229.2
应付托管费		1,497,882.77	975,204.8
应付销售服务费		-	
应付交易费用		6,721,732.77	3,790,948.5
应交税费		-	
应付利息		_	
应付利润		-	
递延所得税负债		_	
其他负债		683,330.37	336,431.8
负债合计		58,875,303.14	61,627,906.8
所有者权益:			
实收基金		2,453,840,758.66	2,462,739,402.4
 未分配利润		4,627,879,881.92	1,762,333,623.7
所有者权益合计		7,081,720,640.58	4,225,073,026.1
布徳和町有来収さり 計	_	7 140 595 943 72	4 286 700 932 9

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额争值 7.2 利润表 会计主体:兴全社会责任混合型证券投资基金 本报告期: 2015年1月1日至2015年12月31日

項目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入		3,164,667,057.88	848,133,213.99
1.利息收入		15,877,044.56	11,466,990.71
其中:存款利息收入		2,912,286.70	1,311,701.60
债券利息收入		12,964,757.86	10,124,578.00
资产支持证券利息收入		-	_
买人返售金融资产收入		-	30,711.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,265,031,540.36	879,492,284.28
其中:股票投资收益		2,244,249,268.62	842,555,650.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,422,941.54	1,067,610.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		18,359,330.20	35,869,023.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		876,623,944.68	-45,167,139.73
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		7,134,528.28	2,341,078.73
诚;二、费用		165,656,642.82	113,200,727.28
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	104,249,208.37	73,747,315.78
2. 托管费	7.4.8.2.2	17,374,868.05	12,291,219.32
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
 交易费用 		43,614,236.42	26,637,149.81
5. 利息文出		-	96,743.98
其中:卖出回购金融资产支出		-	96,743.98
6. 其他费用		418,329.98	428,298.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		2,999,010,415.06	734,932,486.71
诚:所得税费用		-	_
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		2,999,010,415.06	734,932,486.71

項目		本刷 2015年1月1日至2015年12月31日	
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,462,739,402.41	1,762,333,623.72	4,225,073,026.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本 期净利润)	-	2,999,010,415.06	2,999,010,415.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动 数 (净值减少以""号填列)	-8,898,643.75	-133,464,156.86	-142,362,800.61
其中:1.基金申购款	3,056,749,534.11	5,219,518,806.90	8,276,268,341.01
2.基金赎回款	-3,065,648,177.86	-5,352,982,963.76	-8,418,631,141.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,453,840,758.66	4,627,879,881.92	7,081,720,640.58
项目		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	实收基金	 未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,828,604,943.86	1,873,817,808.23	5,702,422,752.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本 期净利润)	-	734,932,486.71	734,932,486.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动 数 (净值减少以 "" 号填列)	-1,365,865,541.45	-846,416,671.22	-2,212,282,212.67
其中:1.基金申购款	850,778,266.87	507,814,423.16	1,358,592,690.03
2.基金赎回款	-2,216,643,808.32	-1,354,231,094.38	-3,570,874,902.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的 基金海值变动(海值减少以"-"是值别)	-	-	-

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

证监索师师的《证券投资盈息》中的"对金融》中的"对金融的《和电台》中的"对战争")原则的正弦表自"国际历史系"中间为"对战争", 证监索师的《证券投资盈金目核算业务指引》编制财务报表。 74. 遗传改金会目核算业务指引》编制财务报表。 74. 遗传公金计相顺及其保存关键定的申明 本财务报表符合财政部颁布的企业会计准顺的要求,真实,完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况。2015年度的经营成果和基 全地在市场报告

*但受到而60。 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

-7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明 7.4.5.1 会计政策变更的说明 本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 视项 無關於程字1998]55号文《財政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放六证券投资基金有关税炊回题的通知》、财税2004]78号文《关于证券投资基金税收定策的通知》、财税2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利规则化个人所得税政策有关问题的通知》,财税2015[10]号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利规则化一人所得税政策有关问题的通知》,此程2025[10]50 文(关于规处等通法战态等关党规定集团间的通知》,上述字字20030]50 文(关于规处等通法战态等关党规定集团间的通知》,上述字字20030(关于微处等通路证券交易印产税和收方式回路上的通知》及规则2003[19]文《财政部、国家税务总局关于企业所得税者干化起政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金运用的通知》,规模2003[19]文《财政部、国家税务总局关于企业所得税者干化起政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金运用的通知》为

(a)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税. (e)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得

NA. 《向对基金取得的股票的股息。在利收入,债券的利息收入,由上市公司,发行债券的企业在向基金支付上述收入时代和代策20%的个人所得免。自2013年1月1日起,对新政律的股度在7和收入根据特限限据差别化计算个人所得税的应纳税所得服,持股职股在7人月以内(含1个月)。 由,其股重和新州各级附入人应纳的网络,持度和政治人员,以下10个人。在1年的,管辖还500叶人应纳税所需要,提供即限组过1年的,股及投资已日为自2013年1月1日起至2015年9月日期间的,暂免被收25%计入应纳税所得据,股权登记日在2015年9月8日及以后的,暂免征收个人所

殳资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入, 暂不征收个人所得税和企业所得税

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司(以下简称"兴业全球基金")	基金管理人。注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")	基金托管人.基金销售机构
兴业证券股份有限公司(以下简称"兴业证券")	基金管理人的股东,基金销售机构
全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V)	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司
7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易	

7.4.8.1.1 股票交	易		金额单位:人民币元		
关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31	B	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
大跌力石粉	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期较票 成交总额的比例	
兴业证券	2,693,827,584.61	8.09%	3,513,751,551.53	18.83%	

7.4.8.1.2 债券交易 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 储参回购交易 本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行储券回购交易。 7.4.8.1.4 保证交易 本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

金额单位:人民				
关联方名称		2015年1月1	本期 日至2015年12月31日	
大阪力会的	当期	占当期佣金总量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
兴业证券	1,913,695.58	8.22%	-	-
关联方名称			- 度可比期间 日至2014年12月31日	
A40.7-099	当期 佣金	占当期佣金总量的比 例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例(%)
兴业证券	2,497,777.56	18.04%	474,708.09	12.52%

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

٠Ĺ	份額单		
1	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	项目
1	19,046,309.33	=	期初持有的基金份額
1	_	3,972,586.41	期间申购/买人总份额
1	_	=	期间因拆分变动份额
1	19,046,309.33	-	滅:期间赎回/卖出总份额
1	_	3,972,586.41	期末持有的基金份額
	-	0.1619%	期末持有的基金份額 占基金总份額比例
ž	ALIN CLOSURE - VANGALIN MALLER A ALINE A ALINE AND AND RESERVE	rida do AATA I ANDE BRANCO	11. Here's a large to the second of the second of the second of

注:,期间申购/平人总价额合红和用货费、寻取人价额,期间明四/头田达印第台中中 和招募谈明书规定的确定、符合公允性要求。 74.84.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 本基金龄基金管理人之外的其他关联方式设置,上年度未均未投资本基金。

关联方		は期 Ε2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
名称	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入	
建设银行	158,465,465.06	2,594,342.09	45,786,218.71	1,123,796	

7.49 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证

7.4.10.1.1 受	限证券类	列,股票								
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受限 类型	认购 价格	期末估值单 价	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
300336	新文化	2015年2月 10日	2016年3 月18日	非公开发 行流通受 限	26.75	38.92	1,200,000	32,100,000.00	46,704,000.00	往
300336	新文化	2015年5月 26日	2016年3 月18日	非公开发 行流通受 限-转增	-	38.92	1,440,000	-	56,044,800.00	
000555	神州信息	2015年1月 12日	2016年1 月22日	非公开发 行流通受 限	33.00	41.37	668,000	22,044,000.00	27,635,160.00	往
000555	神州信息	2015年9月 22日	2016年1 月22日	非公开发 行流通受 限-转增	-	41.37	668,000	-	27,635,160.00	-
300007	汉威电 子	2015年1月7日	2016年1 月11日	非公开发 行流通受 限	29.52	33.81	121,056	3,573,573.12	4,092,903.36	Æ
300007	汉威电 子	2015年10月 20日	2016年1 月11日	非公开发 行流通受 阳-转增	-	33.81	121,056	-	4,092,903.36	-

4、上述可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定,最终日期以上市公司公告为准。

									金额单位	Z:人民i
股票代码	股票 名称	停牌日 期	停牌 原因	期末 估值单价	延牌日 期	短牌 开盘单价	数量(股)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
300336	新文 化	2015年12 月24日	新划 重大 事項	42.00	-	-	2,447,221	96,468,842.55	102,783,282.00	
300063	天龙 集团	2015年12 月22日	新划 重大 事項	43.33	-	-	1,293,142	53,572,265.88	56,031,842.86	
300049	福瑞 股份	2015年11 月30日	新划 重大 事項	33.25	2016年1 月4日	30.95	11,474,538	300,979,337.18	381,528,388.50	
300043	互动 娱乐	2015年12 月17日	等划 重大 事項	15.80	-	-	1,834,500	33,027,686.83	28,985,100.00	-
002502	弊域 股份	2015年8 月20日	等划 重大 事項	32.02	2016年1 月14日	23.35	12,674,289	185,469,545.81	405,830,733.78	-
002174	游族 网络	2015年7 月23日	等划 重大 東西	84.39	2016年2 月15日	80.58	35,000	4,666,549.00	2,953,650.00	-

90172 開發 7231日 東京 84.99 713131 80.58 2 7.4.93 期末傍季正回顾及房中作为抵押的债券 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回顾 本基金本报告期末未转有银行间市场债券正回顾交易中作为抵押的债券 本基金本报告期末未转存及易所市场债券正回顾交易中作为抵押的债券。 7.4.10 有助于理解分别所分计权报偿要证别的比他事项 由于四会五人的原因,分班之和与合计班之间可能存在足差。 5.8.19寄租金储费

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,607,246,488.14	92.5
	其中:股票	6,607,246,488.14	92.5
2	固定收益投资	300,625,000.00	4.2
	其中:债券	300,625,000.00	4.2
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-	
4	金雕衍生品投资	-	
5	买人返售金融资产	-	
	其中:买新式回购的买人返售金融资产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	176,544,558.53	2.4
7	其他各项资产	56,179,897.05	0.7
8	台计	7,140,595,943.72	100.0

占基金资产净值比例(%)	公允价值	行业类别	代码
	-	农、林、牧、渔业	Α
	-	采矿业	В
	5,164,718,181.52	制造业	C
	2,690,000.00	电力、热力、燃气及水生产和供应业	D
	-	建筑业	E
	-	批发和零售业	F
	268,042,641.77	交通运输、仓储和邮政业	G
	-	住宿和餐伙业	Н
	870,904,843.24	信息传输、软件和信息技术服务业	1
	-	金融业	J
	38,569,681.41	房地产业	K
	-	租赁和商务服务业	L
	56,789,058.20	科学研究和技术服务业	М
	-	水利、环境和公共设施管理业	N
	-	居民服务、修理和其他服务业	0
	-	教育	P
	-	卫生和社会工作	Q
	205,532,082.00	文化、体育和娱乐业	R
	-	综合	S
	6,607,246,488,14	台计	

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600867	通化东宝	26,188,800	711,549,696.00	10.0
2	300017	阿宿科技	11,588,800	695,212,112.00	9.8
3	002450	康得新	17,340,757	660,682,841.70	9.
4	300136	信维通信	13,848,388	409,219,865.40	5.7
5	002475	立讯精密	12,803,470	409,070,866.50	5.7
6	002502	界域股份	12,674,289	405,830,733.78	5.7
7	300049	福瑞長份	11,474,538	381,528,388.50	5.3
8	300013	新宁物流	13,382,059	268,042,641.77	3.7
9	000733	振华科技	10,535,571	263,389,275.00	3.7
10	002008	大族激光	8,600,829	222,675,462.81	3.1

8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

1	300017	阿宿科技	1,179,628,794.21	27.92
2	000566	海南海药	966,163,067.37	22.87
3	002063	远光软件	677,841,764.57	16.04
4	002450	原得新	654,229,946.94	15.48
5	002236	大华股份	539,142,232.96	12.76
6	002081	全螳螂	438,439,168.36	10.38
7	600060	海信电器	436,376,531.32	10.33
8	300136	信幣通信	409,383,527.64	9.69
9	300013	新宁物流	384,721,583.92	9.11
10	000555	神州信息	377,842,158.70	8.94
11	300207	放旺达	364,313,879.66	8.62
12	300049	福瑞長份	341,884,992.57	8.09
13	600850	华东电脑	327,137,295.07	7.74
14	601166	兴业银行	298,791,402.84	7.07
15	300336	新文化	282,406,640.08	6.68
16	002329	皇氏集团	275,912,276.67	6.53
17	002008	大族激光	269,597,738.58	6.38
18	000733	振华科技	266,563,216.28	6.31
19	600867	通化东宝	258,893,552.11	6.13
20	600588	用友网络	258,209,302.17	6.11
21	300274	阳光电源	247,044,403.81	5.85
22	002642	菜之联	232,060,023.74	5.49
23	000681	视觉中国	227,253,100.33	5.38
24	000625	长安汽车	206,477,993.31	4.89
25	002055	得洞电子	205,415,041.74	4.86
26	600570	恒生电子	187,761,529.76	4.44
27	300077	国民技术	171,872,388.63	4.07
28 29	000662	索芙特 久其軟件	169,826,354.53 158,515,966.81	4.02
30	600498	外	158,515,966.81 150.084.558.94	3.75
		70天田日 乳散股份		
31	002425 002431	松樹図林	140,961,932.93 129,875,769.28	3.34
33	300346	南大光电	128,446,128,68	3.04
34	002271	东方雨虹	126,821,840.23	3.00
35	600536	中国软件	124,736,722.76	295
36	600969	柳屯団际	123.967.530.42	2.93
37	300171	东富龙	117,787,042.32	2.79
38	002618	丹坂科技	116.545.195.79	2.76
39	002475	立讯精密	116,301,599.03	2.75
40	600066	宇道客车	96,636,999.82	2.29
41	600172	黄河旋风	96,145,108.44	2.28
42	600535	天士力	94,405,790.29	2.23
43	600865	百大集团	93,927,949.89	2.22
44	300063	天龙集团	90,863,734.94	2.15
45	002104	恒宝股份	90,196,908.36	2.13
46	600271	航天信息	86,472,186.06	2.05

金額甲位:人民				
占期初基金资产净值比例(%)	本期累计实出金额	股票名称	股票代码	序号
33.2	1,402,715,165.99	阿密科技	300017	1
16.8	710,174,896.90	远光软件	002063	2
16.6	702,333,426.65	海南海药	000566	3
14.3	607,056,392.74	长安汽车	000625	4
13.5	570,618,124.14	康得新	002450	5
11.1	472,648,752.19	用友网络	600588	6
10.5	447,270,145.83	金螳螂	002081	7
10.4	440,061,187.18	海信电器	600060	8
10.1	427,615,497.75	川投能源	600674	9
8.2	349,347,208.26	万丰奥威	002085	10
8.2	347,575,235.93	大华股份	002236	11
7.5	337,496,931.73	阳光电源	300274	12
7.5	337,030,385.05	神州信息	000555	13
7.0	321,289,119.93	抚顺特铜	600399	14
7.4	313,831,864.96	皇氏集团	002329	15
7.2	309,940,634.11	新文化	300336	16
7.2	305,967,359.99	兴业银行	601166	17
7.2	304,485,180.04	大族激光	002008	18
7.1	303,671,152.25	福瑞辰份	300049	19
7.0	297,038,784.65	放旺达	300207	20
6.8	291,235,435.49	东方雨虹	002271	21
6.1	260,215,265.86	华东电脑	600850	22
5.4	231,350,352.23	恒生电子	600570	23
4.5	210,981,734.40	久其軟件	002279	24
4.8	205,137,105.47	中国软件	600536	25
4.5	198,904,267.71	得闹电子	002055	26
4.4	187,896,898.10	联化科技	002250	27
4.4	186,894,171.04	荣之联	002642	28
4.1	174,468,066.57	凯瑞德	002072	29
3.5	165,474,243.38	航天信息	600271	30
3.7	158,704,223.77	广联达	002410	31
3.3	149,431,418.81	通化东宝	600867	32
3.4	146,695,576.38	超图软件	300036	33
3.2	139,824,979.98	东富龙	300171	34
3.2	138,926,611.04	棕榈团林	002431	35
3.2	135,121,576.77	被定中国	000681	36
2.5	123,598,851.33	中直股份	600038	37
2.7	114,908,815.44	东港股份	002117	38
2.7	113,960,290.81	报华科技	000733	39
2.6	111,897,777.51	柳屯団际	600969	40
2.6	110,780,277.09	恒宝股份	002104	41
2.5	107,877,956.09	合众思壮	002383	42
2.5	107,408,265.63	乐普医疗	300003	43
2.3	100,344,886.95	烽火通信	600498	44
2.2	95,657,893.65	干方科技	002373	45
2.2	95,320,983.67	宇道客车	600066	46
2.0	88,317,755.51	云南盐化	002053	47

8.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	団家债券	-	-
2	央行票据	_	-
3	金融债券	300,625,000.00	4.25
	其中:政策性金融债	300,625,000.00	4.25
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	台计	300,625,000.00	4.25

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150411	15次发11	1,000,000	100,290,000.00	1.
2	150413	15次发13	1,000,000	100,110,000.00	I.
3	150307	15进出07	500,000	50,165,000.00	0
4	150202	15回开02	500,000	50,060,000.00	0.
5	-	-	-	-	

8.8 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贵金属投资明细本基金本报告期末末持有贵金属。

本基金本报告期末来转有贵金属、
9 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时期 本基金本报告期末未接有较证明 8.10报告期末本基金投资的股末期货仓和损益明细 本基金本报告期末未基金投资的股末期货仓和损益明细 本基金本报告期末未持有股指期货仓 8.10.2本基金投税指期的投资资源 是指期货币工资本基金的投资团基、故此项不适用。 8.11报告期末本基金投资的国格期货交易情况说明 8.11报告期末本基金投资的国格期货交易情况说明

平明国顶州页纹页双東 用货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

6.11.3年期国照明页投资评价 国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。8.12 投资组合报告附注

			单位:人民
	序号	名称	金額
	1	存出保证金	3,773,747.2
Ī	2	应收证券清算款	42,275,933.6
	3	应收股利	
	4	应收利息	6,960,292.3
	5	应收申购款	3,169,923.8
	6	其他应收款	
	7	待掩费用	
	8	其他	-
	9	合计	56,179,897.0

8.12.4 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

8.12.5 州末前十名政宗中存在就理支阀間のE的说明 金额单位:人民币元										
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明					
1	002502	弊域股份	405,830,733.78	5.73	筹划重大事项					
2	300049	福瑞轻份	381,528,388.50	5.39	筹划重大事项					
8.12.6 投资组会报告附注的其他文字描述部分 由于四全五人的原因、分所之和与会计师之间可能存在尾差。										

9.1 期末非全份贩持有人户物及持有人结构

§ 9 基金份额持有人信息 .4 期末基金管理人的从业人员持有

§ 10 开放式基金份额变动

11.1 基金份额持有人大会决议
报告期内本基金米召开基金份额持有人大会。
11.2 基金管理人、基金任管人的专「基金任管系)的重大人事变动
(1)报告期内基金管理人类人事变动。
2015年3月26日公告、公司副总经理徐本至于2015年3月24日起源任。
2015年3月26日公告、公司副总经理徐本至于2015年3月36日起任职。公司副总经理杜昌勇于2015年4月30日起嘉任。
2015年6月4日公告、公司副总经理佛斯于2015年6月30日起任职。公司副总经理杜昌勇于2015年4月30日起嘉任。
(2)郑告期内本基金任管人的专门基金任管部门重大人事变动。
本基金任管人的15年1月4日发布任金通知,即任张分岭为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金任管人2015年9月18日发布任金通知,解明纪任中国建设银行投资任管业务部副总经理。本基金任管人2015年9月18日发布任金通知,解明纪任中国建设银行投资任管业务部副总经理。

报告期外无涉及本基金管理人基金财产基金经营业务的诉讼事项。
11.基金投资等除改变。
报告期内本基金投资等除失发生改变。
13.为基金进行审计的会计师等分析法。
为进一步维护基金持有人利益。合理控制基金定作成本,同时促进会计师事务持续提供更优质的服务,根据基金管理人内部制度要求及
当即代配势、基础的审计机由此中次年明会计师事务所(特殊普通合伙)更定为单马级中级会计师事务所(特殊普通合伙)。本年度审计
为为万元。本次会计师事务所的变更已经基金管理人董事会组成,并履行了必要的程序。
11.6 管理人尤指区 及其高级管理人员 经营业成份可管抗区
报告期内本基金管理人基金任管人员的任管业务和了及其相关高级管理人员未交到监管部门的稽查或处罚。
11.7基金相用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位人尺千元。

田主:1.根20年上四川市公司 現交易館位。 2.本报告期本基金租用证券公司交易单元较上年度可比期间未发生变化。 3.中泰证券原名为齐鲁证券 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

						金额甲位:人民中
	债券交易		债券回购	均交易	权证交易	
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金額	占当期权证 成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	8,815,012.10	100.00%	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
海道证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
铝可证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
団元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息