基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

§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连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
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3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
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。
本报告期自2015年1月17日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘云端生活优选
基金主代码	001030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月17日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	599,604,262.21
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,利用公司大数据研究优势优选与居民生活密切相关的大消费及相关行业的优质企业进行投资,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取灵活资产配置、主动投资管理的投资模式,在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先是进行大类资产配置,在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险,把握市场波动产生的投资机会;其次是充分发挥公司大数据研究平台的优势,通过建立量化模型优选具有良好投资价值的投资品种,构建投资组合。
业绩比较基准	60%*中证主要消费指数收益率+40%*中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于中等风险、中等收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童继林	林雅
	联系电话	022-83310208	010-66060069
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgxq@fubachina.com
客户服务电话		4007109999	95599
传真		022-83865569	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年3月17日-2015年12月31日
本期已实现收益	72,227,145.19
本期利润	84,382,029.25
加权平均基金份额本期利润	0.0930
本期基金份额净值增长率	-7.84%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0784
期末基金资产净值	552,567,343.99
期末基金份额净值	0.9216

注:1.上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(例如,开放式基金的申购赎回费等),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.期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
4.本基金合同2015年3月17日起生效,报告期为2015年3月17日至2015年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①1	份额净值增长率标准差②2	业绩比较基准收益率③3	业绩比较基准收益率标准差④4	①-③	②-④
过去三个月	11.17%	1.78%	11.10%	0.99%	0.07%	0.79%
过去六个月	-21.07%	2.42%	-5.15%	1.64%	-15.92%	0.78%
自基金合同生效日起至今(2015年03月17日-2015年12月31日)	-7.84%	2.44%	11.31%	1.61%	-19.15%	0.83%

注:1.业绩比较基准=60%*沪深300指数收益率+40%*中证综合债指数收益率
2.按照本基金合同的约定,基金于4个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定,本基金的建仓期为2015年3月17日-2015年9月16日,建仓期结束时,各项资产配置比例均符合基金合同的约定。
3.本报告期内,本基金的净值收益率与业绩比较基准收益率的比较的长期走势图:

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

阶段	份额累计净值增长率②1	业绩比较基准收益率③2	②-③
过去三个月	11.17%	11.10%	0.07%
过去六个月	-21.07%	-5.15%	-15.92%
自基金合同生效日起至今(2015年03月17日-2015年12月31日)	-7.84%	11.31%	-19.15%

注:①为基金业绩指标与沪深300指数收益率+40%*中证综合债指数收益率的比较。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额累计净值增长率①1	份额累计净值增长率标准差②2	业绩比较基准收益率③3	业绩比较基准收益率标准差④4	①-③	②-④
过去三个月	11.17%	1.78%	11.10%	0.99%	0.07%	0.79%
过去六个月	-21.07%	2.42%	-5.15%	1.64%	-15.92%	0.78%
自基金合同生效日起至今(2015年03月17日-2015年12月31日)	-7.84%	2.44%	11.31%	1.61%	-19.15%	0.83%

注:①为基金业绩指标与沪深300指数收益率+40%*中证综合债指数收益率的比较。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

本报告期:2015年3月17日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	期初净值	期末净值	变动率
1.期初所有者权益(基金净值)	1,509,622,448.13	1,509,622,448.13	-
2.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	84,382,029.25	84,382,029.25	-
3.本期基金份额交换产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,041,437,133.39	-1,041,437,133.39	-
其中:1.基金申购款	847,538,973.40	847,538,973.40	-
2.基金赎回款	-1,888,976,106.79	-1,888,976,106.79	-
4.本期末所有者权益(基金净值)	552,567,343.99	552,567,343.99	-

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值0.9216元,基金份额总额599,604,262.21份。
2.本财务报表的实际编制期间为2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日,无上一年度可比期间(下同)。
7.2 利润表
会计主体:天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年3月17日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年3月17日至2015年12月31日
一.收入		115,530,035.05
1.利息收入		4,989,053.40
其中:存款利息收入	7.4.7.11	561,917.87
债券利息收入		3,313,164.94
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,113,970.59
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		77,804,525.91
其中:股票投资收益	7.4.7.12	71,184,927.94
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	433,555.08
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	6,186,042.89
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	12,154,884.06
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	20,581,571.68
减:二.费用		31,148,005.80
1.管理人报酬		11,214,413.85
2.托管费		1,869,068.90
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.4.7.19	17,632,551.21
5.利息支出		62,233.81
其中:卖出回购金融资产支出		62,233.81
6.其他费用	7.4.7.20	369,738.03
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		84,382,029.25
减:所得税费用		-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		84,382,029.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年3月17日至2015年12月31日
单位:人民币元

项目	本期 2015年3月17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)	1,509,622,448.13	-	1,509,622,448.13
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	84,382,029.25	84,382,029.25
三.本期基金份额交换产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-910,018,185.92	-131,418,947.47	-1,041,437,133.39
其中:1.基金申购款	656,053,406.22	191,485,567.18	847,538,973.40
2.基金赎回款	-1,566,071,592.14	-322,904,514.65	-1,888,976,106.79
四.本期向基金分红股东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)	599,604,262.21	-47,036,918.22	552,567,343.99

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

麻柳强	韩高潮	潘贺龙
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会基金管理委员会以下简称"中国证监会")证监许可[2015]90号《关于核准天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由天弘基金管理有限公司发行募集(以下简称"天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金募集期")。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间募集了1,509,622,448.13份基金份额,其中认购资金利息折合244,406.90份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、可转换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金股票投资比例为基金资产的0%~95%,投资于债券及相关衍生品的证券资产不低于非现金基金资产的90%;投资于权证的比例不超过基金资产的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的金融比较基准:中证主要消费指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。
本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2016年3月25日批准报出。
7.4.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会公布的《证券投资基金会计科目设置指引》、《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金合同》和本基金招募说明书的有关规定编制。
本财务报表以本基金持续经营为基础列报。
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。
7.4.4 重要会计政策和会计估计
7.4.4.1 会计年度
本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止,本期财务报表的实际编制期间为2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日。
7.4.4.2 记账本位币
本基金的记账本位币为人民币。
7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类
(1)金融资产的分类
金融资产下初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。
本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。
本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。
(2)金融负债的分类
金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债,本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。
7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。
对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,期末公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。
金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给对方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。
金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。
当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分,终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。
7.4.4.5 金融资产和金融负债的公允价值确定原则
本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按取下面列确定公允价值并进行估值:
(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化,市场价格未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。
(2)存在活跃的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。
(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被认定市场实际交易价格或其可观察的估值技术确定公允价值,估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等,采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。
7.4.4.6 应收款项和其他金融负债的确认标准
本基金持有的资产和负债基本为金融资产和金融负债,当本基金为具有影响已确认金融资产的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且为交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。
7.4.4.7 实收基金
实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除掉证平准金分摊部分后的余额,由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日入账。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。
7.4.4.8 摊销平准金
摊销平准金包括已实现平准金和未实现平准金,已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额,未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额,摊销平准金于基金申购确认日或赎回确认日计入,并于期末金额转入实现利润(累计亏损)。
7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量
投资投资收益包括:股票投资收益、债券投资收益、衍生工具投资收益、股利收益。股票投资收益在持有期间应取得的股票股利和现金股利时确认为投资收益,债券投资收益在持有期间应取得的债券利息和在处置时确认为投资收益,衍生工具投资收益在处置时确认为投资收益,股利收益在被投资企业宣告分配股利时确认为投资收益。
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。
应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
7.4.4.10 费用的确认和计量
本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费按照前一日基金资产净值的年费率计算,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。
其他金融负债在按有期间应取得的利息收入按实际利率计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
7.4.4.11 分配原则
本基金的可供分配利润指期末可供分配基金份额利润与期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数。
7.4.4.12 预计负债的确认和计量
本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费确认金额为:按照相应费用计提的金额。
其他金融负债在有期间应取得的利息收入按实际利率计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
7.4.4.13 收入
本基金的收入主要为:股票投资收益、债券投资收益、股利收益、银行存款利息收入。
股票投资收益在证券交易日确认,按成本法计算。
债券投资收益按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
股利收益在被投资企业宣告分配股利时确认为投资收益。
7.4.4.14 费用
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2003]173号《关于证券投资基金税收问题的通知》,财税[2003]285号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2005]102号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》,财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税应税劳务,不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入,增值税应税销售额为零,不予征收营业税。
(2)对基金以证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税,对基金从上述债券的利息收入中扣除。
(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司*(中国农业银行*)	基金管理人的股东、基金托管人
浙江省权小微金融服务集团有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
梵高商新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天福博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天都新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚富兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司*(天弘创新*)	基金管理人的全资子公司

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
2.2015年度内,本基金管理人股东*内蒙古君正能源化工股份有限公司*的名称变更为*内蒙古君正能源化工集团股份有限公司*。
3.根据本基金管理人于2015年2月13日披露的关于完成增资扩股相关工商变更登记的公告,浙江省权小微金融服务集团有限公司、新疆天阜博丰股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天都新盟股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天聚富兴股权投资合伙企业(有限合伙)为本基金管理人新增股东。
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
本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。
7.4.8.2 关联方报酬
7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月17日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,214,413.85
其中:支付销售机构的客户维护费	5,292,380.20

注:1.支付基金托管人高通证券的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。
7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券合回购交易
本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券合回购交易。
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

单位:人民币元

项目	本期 2015年3月17日至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年3月17日)持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,633,399.87
基金合同生效日起至报告期期末基金份额分红份额	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
期末持有的基金份额	16,633,399.87
期末持有的基金份额占基金份额比例	2.77%

注:基金管理人天弘基金管理有限公司在本年度申购本基金的父基委托直销柜台办理,适用费率为每笔1000元。
7.4.8.4.2 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
本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。
7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年3月17日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	28,221,441.32	350,271.69

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期在承销期内参与关联方承销证券的情况。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。
7.4.9 利润分配情况
7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金
本基金本报告期未进行利润分配。
7.4.10 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。
7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600153	建发股份	2015-06-29	重大资产重组	14.69	-	-	613,890	13,206,842.36	9,018,044.10
300351	永贵电器	2015-10-19	重大资产重组	31.30	2016-02-18	29.80	199,300	5,594,234.00	6,238,090.00
300036	超图软件	2015-10-30	重大资产重组	43.18	2016-01-15	35.11	143,900	5,623,566.08	6,213,602.00
002612	朗姿股份	2015-12-23	和被露重大事项	75.46	-	-	75,600	5,646,912.60	5,704,776.00

注:1.基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能严生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。
7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购
截至本报告期末2015年12月31日,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购
截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款金额27,900,000.00,于2016年1月6日到期。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	517,649,356.37	87.32
	其中:股票	517,649,356.37	87.32
2	固定收益投资	39,966,278.90	6.74
	其中:债券	39,966,278.90	6.74
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	32,431,574.32	5.47
7	其他各项资产	2,760,066.50	0.47
8	合计	592,807,276.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	57,389,063.27	10.39
B	采矿业	-	-
C	制造业	345,128,104.70	62.46
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	30,123,900.10	5.45
G	交通运输、仓储和邮政业	7,586,131.98	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,973,666.75	4.16
J	金融业	-	-
K	房地产业	17,896,017.71	3.24
L	租赁和商务服务业	11,898,582.60	2.15
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	24,653,889.26	4.46
S	综合	-	-
	合计	517,649,356.37	93.68

8.3 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

金额单位:人民币元

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	002429	兆驰股份	1,962,539	24,904,619.91	4.51
2	300103	达刚路机	794,500	21,125,755.00	3.82
3	002321	华英农业	1,579,052	20,859,276.92	3.77
4	300367	东方网力	270,554	18,857,613.80	3.41
5	600433	冠豪高新	1,630,706	18,687,890.76	3.38
6	600963	岳阳林纸	2,172,917	17,883,106.91	3.24
7	600735	新华锦	714,400	17,159,888.00	3.11
8	000049	德赛电池	296,700	16,846,626.00	3.05
9	002665	首航节能	532,900	16,253,450.00	2.94
10	300097	智云股份	346,132	16,077,831.40	2.91

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600559	老白干酒	83,755,873.95	15.16
2	002714	牧原股份	74,216,324.81	13.43
3	000596	古井贡酒	71,885,041.67	13.01
4	002646	天佑德酒	67,602,696.62	12.24
5	300178	腾邦国际	58,887,574.60	10.66
6	601688	华泰证券	57,693,033.19	10.44
7	002299	圣农发展	57,251,669.26	10.36
8	000971	高升控股	54,981,675.56	9.95
9	600029	南方航空	54,130,238.46	9.80
10	002321	华英农业	52,873,648.22	9.57
11	300152	科融环境	52,149,452.15	9.44
12	600115	东方航空	51,952,554.90	9.40
13	600750	江中药业	50,776,304.53	9.19
14	000712	锦龙股份	49,675,036.27	8.99
15	002304	洋河股份	49,155,899.15	8.90
16	000998	隆平高科	48,156,837.99	8.72
17	601166	兴业银行	47,990,882.87	8.69
18	600030	中信证券	47,863,979.99	8.66
19	002719	麦趣尔	45,798,470.15	8.29
20	002477	雏鹰农牧	44,527,230.52	8.06
21	600850	华东电脑	42,466,444.40	7.69
22	600109	国金证券	42,059,786.88	7.61
23	002746	仙坛股份	41,730,085.00	7.55
24	000858	五粮液	41,408,027.42	7.49
25	600038	中直股份	40,828,802.01	7.39
26	000001	平安银行	40,667,627.31	7.36
27	000802	北京文化	40,648,446.26	7.36
28	600990	四创电子	40,534,596.32	7.34
29	000869	张裕A	40,306,176.51	7.29
30	002429	兆驰股份	39,019,739.31	7.06
31	002160	常铝股份	38,660,017.76	7.00
32	600765	中航重机	36,746,667.35	6.65
33	000568	泸州老窖	36,546,480.60	6.61
34	601318	中国平安	36,538,028.82	6.61
35	002407	多氟多	36,306,469.00	6.57
36	600965	福成五丰	35,227,846.87	6.38
37	002736	国信证券	34,419,078.51	6.23
38	600872	中炬高新	34,296,678.43	6.21
39	300072	三聚环保	33,894,780.00	6.13
40	002100	天康生物	33,586,656.98	6.08
41	300422	博世科	33,453,354.75	6.05
42	002234	民和股份	33,350,715.92	6.04
43	600332	白云山	33,318,081.77	6.03
44	600415	小商品城	32,154,369.46	5.82
45	002020	京新药业	31,891,344.35	5.77
46	000861	海印股份	31,611,935.44	5.72
47	002555	顺荣三杰	31,069,815.14	5.62
48	600837	海通证券	30,932,635.84	5.60
49	000722	湖南发展	30,901,736.08	5.59
50	600737	中粮屯河	30,722,423.13	5.56
51	002466	天齐锂业	30,356,098.10	5.49
52	600893	中航动力	30,150,975.04	5.46
53	002268	卫士通	30,103,379.43	5.45
54	600571	信雅达	30,075,440.43	5.44
55	603442	天银机电	29,655,151.76	5.37
56	002604	龙力生物	29,420,886.49	5.32
57	300304	云能电气	29,323,524.24	5.31
58	600376	首开股份	29,251,893.90	5.29
59	300384	三联虹普	29,225,837.82	5.29
60	601607	上海医药	29,193,655.90	5.28
61	002157	正邦科技	28,988,835.27	5.25
62	002154	报喜鸟	28,906,485.91	5.23
63	600153	建发股份	27,987,133.25	5.06
64	000089	深圳机场	27,829,282.54	5.04
65	300159