

(上接B50版)

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	150419	15券发19	1,500,000	150,285,000.00	14.71
2	150405	15券发05	1,150,000	121,405,500.00	11.88
3	158026	15券17	800,000	81,192,000.00	7.94
4	150210	15券10	600,000	65,016,000.00	6.36
5	10155607	15津城债MTN002	400,000	40,196,000.00	3.93

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货币市场基金投资明细

本基金本期期末未持有货币市场基金投资

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

本基金本期期末未持有贵金属。

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

本基金本期期末未持有权证。

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五名股指期货交易情况说明

本基金本期期末未持有股指期货投资。

10、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国债期货交易情况说明

本基金本期期末未持有国债期货投资。

11、投资组合报告附注

(1)报告期末本基金的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行人未受到行政处罚和处罚。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	521,179.58
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股息	11,920,492.68
5	应收申购款	92,868,324.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,309,996.36

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	8,428,200.00	0.82
2	113008	电气转债	1,376,700.00	0.13

(5)报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本期前十名股票中不存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他描述部分

由于基金人不同的原因,分项和与会计计划可能存在偏差。

十二. 基金的业绩

基金业绩截止日为 2015 年 12 月 31 日,所载数据未经审计。

基金经理定期向投资人披露基金的定期报告和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金经理指标包括但不限于买入或卖出交易在交易所的每项费率,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

(1)交易银行间回购协议 A/B:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	2.06%	0.18%

(2)交易银行间回购协议 C:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

(3)交易银行间回购协议 A:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

(4)交易银行间回购协议 C:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

(5)交易银行间回购协议 A:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

(6)交易银行间回购协议 C:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

(7)交易银行间回购协议 A:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单利差②	业绩比较基准 收益率单利差③	业绩比较基准 收益率单利标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.10%	0.28%	1.81%	0.08%	6.29%	0.20%
2015年度	21.02%	0.34%	4.18%	0.08%	16.84%	0.26%
2014年度(自基金 合同生效日起至 2014年12月31 日)	7.78%	0.29%	5.72%	0.11%	1.86%	0.19%

(8)交易银行间回购协议 C:

阶段	份额净值增长 率单利①	份额净值增长 率单