

(上接5版)

(2)法律法规及中国证监会规定的和(基金合同)约定的其他投资限制。  
本基金在开始进入指数期货投资之前,应与基金管理人就股指期货清算、估值、交割等事宜另行具体协商。

因证券市场波动、基金规模变动、股权置换改革支付对价等基金管理人之外的因素致使其基金投资比例不符合上述规定比例的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整。

基金管理人应当将基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金管理人对基金的投资监督与自查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2.禁止行为  
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;  
(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外;

(5)向其基金管理人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券市场交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

(八)基金投资代表人行使权利和履行义务的处理原则及方法

1.不得买卖上市交易的基金,不得买卖所投资公司的经营性资产;

2.有义务按照有关法律规定履行信息披露义务;

3.基金管理人按照有关规定对基金的资产进行估值,保护基金份额持有人的利益;

4.基金管理人按照有关规定对基金的资产进行估值,保护基金份额持有人的利益。

(九)基金的融资融券

本基金可以根据法律法规和政策的规定进行融资、融券。

(十)基金的组合投资情况

基金管理的董事会及董事声明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。

基金管理人于中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年2月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告和投资运作等内,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告数据截止日为2015年12月31日(未经审计)。

1.报告期本基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 175,722,203.33 73.22

其中:股票 175,722,203.33 73.22

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

贵金属 - -

3 货币市场投资 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购待返售金融资产 - -

6 衍生工具及备付金合计 59,202,555.94 24.84

7 其他资产 3,445,009.21 1.45

8 合计 238,370,185.48 100.00

2.报告期未按行业分类的股票投资组合

2.1报告期未按行业分类的境内股票投资组合

序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 制造业 127,722,716.09 53.99

3 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

4 建筑业 - -

5 批发和零售业 222,304.44 0.09

6 交通运输、仓储和邮政业 - -

7 住宿和餐饮业 - -

8 信息传输、软件和信息技术服务业 35,329,519.80 14.94

9 金融业 - -

10 房地产业 - -

11 其他服务业 - -

12 合计 175,722,903.33 74.29

2.2报告期未按行业分类的沪港通股票投资组合

2.3报告期未按行业分类的深港通股票投资组合

2.2.报告期未按行业分类的沪港通股票投资组合

本基金报告期末未通过沪港通机制投资股票。

2.3.报告期未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	300109	乐视网	156,142	16,246,575.10	6.87
2	600308	新宝股份	402,820	12,616,322.40	5.33
3	002284	亚太股份	565,069	11,685,626.92	4.94
4	002337	深华新	487,770	11,218,710.00	4.74
5	002594	青岛啤酒	334,503	10,419,768.45	4.60
6	300001	利亚德	344,100	9,978,900.00	4.22
7	300352	北斗星	152,000	9,484,800.00	4.01
8	300007	汉威电子	259,766	8,883,997.20	3.76
9	300367	东方国信	126,340	8,805,898.00	3.72
10	300188	亚联电子	167,000	8,466,900.00	3.58

4.报告期按照行业分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

5.报告期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

本基金报告期末未持有债券。

6.报告期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

本基金报告期末未持有资产支持券。

7.报告期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

本基金报告期末未持有贵金属。

8.报告期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

本基金报告期末未持有权证。

9.报告期按照行业分类的股票投资情况

10.本期国债投资情况

11.本报告期投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12.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库。

13.其他资产构成

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 应收利息 - -

2 应收股利 - -

3 应收申购款 - -

4 应收承兑汇票 - -

5 应收保理款 - -

6 其他应收款 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 3,445,009.21 -

10.报告期本基金投资的国家国债情况

11.本报告期投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

12.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库。

13.其他资产构成

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 应收保证金 408,797.94 -

2 应收申购款 2,019,653.63 -

3 应收股利 20,476.45 -

4 应收利息 6,081.19 -

5 应收申购款 - -

6 其他应收款 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 3,445,009.21 -

14.报告期未持有处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

15.5月末报告期末前十名股票不存在流通受限的情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

16.投资组合报告附注

17.本报告期投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

18.各销售机构的销售网点以及开户、申购、赎回、转换业务等事项的详细情况请向各销售机构咨询。

19.风险揭示

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件以及风险揭示和免责声明的内容,了解基金的风险特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断是否适合购买该基金,并根据自身的风险承受能力选择购买基金,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

20.本基金2016年第3期运作周期的开放日安排如下:申购(含转换转入)开放日为2016年3月18日至2016年3月24日的工作日,其中2016年3月24日(仅接受开放式基金的开放式申购)赎回(含转换转出)开放日为2016年3月23日;赎回(含转换转出)开放日为2016年3月24日。

21.本基金2016年第3期运作周期的申购费用按申购金额的0.5%收取。

22.本基金2016年第3期运作周期的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

23.本基金2016年第3期运作周期的转换费用按转换金额的0.5%收取。

24.本基金2016年第3期运作周期的定期定额投资费用按月定期定额投资金额的0.5%收取。

25.本基金2016年第3期运作周期的转换理财费用按转换金额的0.5%收取。

26.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金费用按转换金额的0.5%收取。

27.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

28.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换费用按转换金额的0.5%收取。

29.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换理财费用按转换金额的0.5%收取。

30.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

31.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的转换理财费用按转换金额的0.5%收取。

32.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

33.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换理财费用按转换金额的0.5%收取。

34.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

35.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

36.本基金2016年第3期运作周期的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的转换货币型基金的赎回费用按赎回金额的1.5%收取。

37.本基金2016年第3期运作周期的转换