基金管理人:益民基金管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
送出日期:2016年3月26日

益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

§1 重要提示

1.1 重要提示

本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。

本基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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、误导性陈述或者重大遗漏。

本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。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	益民服务领先混合
基金主代码	000410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月13日
基金管理人	益民基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	130,041,359.29份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在中国经济转型发展和产业升级加快的大背景下,积极把握服务业加速成长、逐渐转型成为经济发展主要动力的机会,在分享企业成长性的同时合理控制组合风险,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金管理人通过益民经济周期模型与分析师的审慎研究相结合的方式,密切跟踪全球和中国宏观经济因素变化的情况,从经济增长、国家政策、市场资金面、海外市场环境等多个方面进行深入研究,判断证券市场总体变动趋势。结合对证券市场各资产类别中长期运行趋势、风险收益特征的分析比较,确定基金大类资产配置比例和变动原则。本基金所指的服务业从服务对象上可以分为生产性服务业和生活性服务业。本基金将从这两大方面出发明确界定属于服务业的相关行业,严格遵照投资范围进行投资。同时,本基金还将密切跟踪国家政策和产业升级变化情况,研究随国民经济发展和科学技术进步带来的领导经济、产业转型升级的服务业所涵盖的行业范围的拓展和变化,适时调整投资范围,确保本基金对服务类行业和上市公司的投资比例符合服务业的界定。
业绩比较基准	65%×沪深300指数收益率+35%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金,但高于债券型基金和货币市场基金

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		益民基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘伟	张建春
	联系电话	010-63106556	010-63639180
	电子邮箱	jts@ymfund.com	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-680-8808	95595
传真		010-63100588	010-63639132

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.ymfund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区宣外大街10号庄胜广场中央办公楼南翼13A

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年12月13日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	71,707,969.46	7,975,392.10	2,107,931.55
本期利润	72,885,748.06	10,731,598.64	2,107,931.55
加权平均基金份额本期利润	0.6554	0.0409	0.0019
本期基金份额净值增长率	117.70%	15.57%	0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	1.2248	0.1396	0.0019
期末基金资产净值	327,769,262.49	63,829,285.86	1,086,231,664.25
期末基金份额净值	2.521	1.158	1.002

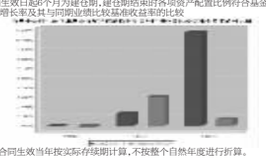
3.2 基金净值表现

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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.17%	1.72%	11.70%	1.08%	3.47%	0.64%
过去六个月	10.72%	1.35%	-8.52%	1.74%	19.24%	-0.39%
过去一年	117.70%	1.68%	8.56%	1.61%	109.14%	0.07%
自基金合同生效起至今	152.10%	1.40%	44.92%	1.26%	107.18%	0.14%

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

注:1.图示日期为2013年12月13日至2015年12月31日。
2.按照基金合同约定,本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2013年12月13日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。
3.2 过去三年基金的利润分配情况
本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

益民基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批准,于2005年12月12日正式成立,公司股东由重庆国际信托股份有限公司(出资比例49%)、中国新纪元有限公司(出资比例31%)、中山证券有限责任公司(出资比例20%)组成,注册资本1亿元人民币,注册地:重庆,主要办公地点:北京。截止2015年末,公司管理的基金共有七只,均为开放式基金,其中,益民货币市场基金于2006年7月17日成立;益民红利成长混合型证券投资基金于2006年11月21日成立;益民创新优势混合型证券投资基金于2007年7月11日成立;益民多利债券型投资基金于2008年8月21日成立;益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金于2012年8月17日成立;益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金于2013年12月13日成立,益民品质升级灵活配置混合型证券投资基金于2015年5月6日成立,首发规模近14亿份。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李进霞	益民货币市场基金基金经理、益民多利债券型证券投资基金基金经理、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015年6月16日	-	8	曾任国家开发银行信贷经理、联合证券研究所研究员、大公国际资信评估有限公司信用分析师。2011年加入益民基金管理有限公司,先后担任研究部研究员、基金经理助理。自2013年9月13日起任益民货币市场基金基金经理;自2014年9月25日起任益民多利债券型证券投资基金基金经理;自2015年6月16日起任益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:此处的"任职日期"为基金合同生效日或根据公司决定确定的聘任日期,"离职日期"为根据公司决定确定的解聘日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期,益民基金管理有限公司作为益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金的管理人,严格按照《基金法》、《证券法》、《益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,以基可能减少和分散投资风险,力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标,管理和运用基金资产,无损害基金持有人利益的行为,基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规性的专项说明

4.3.1 公平交易制度和执行方法

为了保证公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者的合法权益,避免出现不公平交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《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原则(试行)》的要求,制定了《益民基金管理有限公司公平交易管理制度》。《益民基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》,并建立了有效的异常交易行为识别控制机制和报告流程,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司严格遵守公平交易管理制度的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合。对于交易所公开竞价交易,公司以执行交易系统中的公平交易程序,即按照时间优先、价格优先的原则对交易指令进行有序分析,以期获取同时有利于各个公平交易程序的交易指令,需履行同先审批表格;对不同投资组合发出行使投票一致决议的投票权,非公开发行股票等非指令交易的投资决策,各投资组合经理需要在交易前独立地确定各投资组合的交易数量,公司在获配额度确定后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;公司根据市场公认的第三方信息,对投资组合与交易对手之间以价交易的交易价格公允性进行审查,相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,不存在直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送的行为。

本报告期内,各投资组合1季度、3季度、4季度的交易价差通过统计检验,不存在价差显著的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生可能导致不公平交易及利益输送的异常交易行为。不同投资组合之间不存在交易所公开竞价同日反向交易,不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年,经济缓慢下行仍在详底,通胀总体维持低位略有上行,财政货币政策维持宽松格局,人民币加入SDR,新汇改加速推进,美联储加息落地,人民币阶段性贬值,中国金融监管强化,去杠杆控风险,在上证因素综合影响下,A股市场波动、分化均较大,全年呈N型走势。上证指数、创业板分别上涨9.4%、84.4%;行业表现方面,计算机、餐饮旅游、通信、轻工、纺织服装等行业涨幅居前,建筑、金融、石化、钢铁、煤炭等传统行业涨幅落后;主题概念方面,IP、网络安全、大数据、生物识别、互联网金融等板块表现较为突出。

本基金今年在热点和节奏上把握的比较到位,通过"成长+主题+波段+仓位管理"的操作策略,全年收益117.7%,大幅跑赢了业绩比较基准和主要市场指数,为投资者获得了较老的绝对和超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期末,本基金份额净值为2.521元。本报告期份额净值增长率为117.70%,同期业绩比较基准收益率为8.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,考虑到经济尚未企稳,通胀有回升的态势,人民币仍有较值压力,货币政策及利率下行的空间受限,供给侧改革加速推进,本基金认为,市场可能是震荡向上的行情,市场有波动,波动的幅度会小于2015年,但频次可能会多于2015年,并且行业、个股之间的分化会更明显,需精选个股、做好波段,并合理利用仓位,做好攻防。基于此,我们将重点关注国企改革、新型服务业、供给侧改革等领域进行选股布局,加强学习研究、与时俱进,合理平衡风险与机遇之间的关系,继续为投资者创造理想、可观、可持续的绝对回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面:

1.根据基金管理法律法规的最新变化,推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程,制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度,确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性,并加强内控执行力,将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2.日常监察和专项监察相结合,通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法,加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测,并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查,完成了对投资研究、交易环节及后台运营等专项监察。

3.规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中,严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》及其实施规则,审查宣传推介材料,逐步落实完善宣传推介材料,并且有效地规范其实质。

4.规范基金投资业务,保证投资管理工作规范有序,合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制,投资业务均按照管理制度和业务流程执行,以投资决策委员会为最高投资决策机构,并且有效地规范其实质。

5.以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训,促进公司合规文化的建设,及时向公司传达基金相关的法律法规;加大了对员工行为的监察稽核力度,从源头上防范合规风险,防范利益输送行为。

公司日成立以来,各项业务运作正常,内部控制机风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心,进一步提高内部监察工作的科学性和有效性,切实保障基金合规高运作,充分保障基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1.有关参与估值流程各方及人员的情况说明:无。

根据相关规定,本基金管理人成立估值委员会,估值委员会是基金估值的最高决策机构,负责公司估值相关决策及执行。成员由公司总经理、投资总监、运作保障部、金融工程部、监察稽核部、基金会计等相关人员组成。相关参与人员均具有上市公司研究和估值、基金投资等方面较丰富的经验,熟悉相关法规和估值方法。

研究部行业研究员:研究部负责人及行业研究员负责长期价值研究并为投资决策提供投资顾问。

基金会计部:负责根据相关法律法规及基金合同规定,在每日公司净值计算的基础上,对基金份额持有人的权益进行核算,并复核公司管理人计算的基金份额净值。

风控部:负责对公司管理的证券投资品种的风险管理和监控,并提出合理的建议。

2.估值方法及估值技术

公司根据《证券投资基金会计核算业务指引(试行)》、《证券投资基金会计核算业务指引(试行)之估值业务指引》、《证券投资基金会计核算业务指引(试行)之证券投资业务指引》、《证券投资基金会计核算业务指引(试行)之衍生工具业务指引》、《证券投资基金会计核算业务指引(试行)之证券投资业务指引(修订)》、《证券投资基金会计核算业务指引(试行)之衍生工具业务指引(修订)》、《证券投资基金会计核算业务指引(试行)之其他业务指引(修订)》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号:年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号:会计报表附注的编制及披露》、《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》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4 重要会计政策和会计估计

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

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需变动会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局颁布印花税暂行条例,自1988年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局颁布关于调整证券(股票)交易印花税税率等有关问题的通知,自1997年5月5日起,证券(股票)交易印花税税率暂减为1‰;

根据财政部、国家税务总局颁布《关于证券(股票)交易印花税征收问题的通知》的规定,自2005年1月1日起,证券(股票)交易印花税税率暂减为1‰;

根据财政部、国家税务总局颁布《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局颁布《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》的规定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局颁布《关于证券投资税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局颁布《关于证券投资税收政策的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局颁布《关于证券投资税收政策的通知》的规定,对证券投资基金从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.个人所得税

根据财政部、国家税务总局颁布《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》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局颁布《财税[2005]103号》《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局颁布《财税[2008]132号》《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
益民基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司("光大银行")	基金托管人、基金代销机构
重庆国际信托股份有限公司	基金管理人的控股股东
中山证券有限责任公司("中山证券")	基金管理人的股东、基金的代销机构
中国新纪元有限公司	基金管理人的股东
国投资产管理有限公司	基金管理人子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	
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股票交易。	
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 债券回购交易	
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回购交易。	
7.4.8.1.4 权证交易	
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。	
7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金	
本基金本报告期及上年度可比期间均未应支付关联方的佣金。	
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
当期发生的基金应支付的管理费	2,639,737.87	3,863,711.75
其中:支付销售机构的客户维护费	295,768.14	792,162.00

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.50%/当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.2 基金托管费 单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	606,123.41	643,952.01

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.25%/当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

7.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均无销售服务费。

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

本基金于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

本基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末基金管理人所持有的本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	217,796,538.69	791,547.60	208,826.65	303,646.94

7.4.8.6 本基金承销期内发行股票或债券情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未承销期内股票或债券。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而流通受限的证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600502	安徽水利	2015年10月20日	重大事项	13.67	-	-	1,352,431	15,969,811.96	18,487,731.77	-
600168	武汉控股	2015年9月30日	重大资产重组	10.92	-	-	984,600	10,106,898.80	10,751,832.00	-
002246	北化股份	2015年11月23日	重大事项	14.12	-	-	328,090	3,447,558.34	4,632,630.80	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应付证券清算款、应付交易费用等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1) 各项应收金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的金额为人民币21,858,990.84元,属于第二层次的金额为人民币69,258,353.17元,属于第三层次的金额为人民币零元。

(2) 公允价值层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

§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	55,731,185.41	16.92
	其中:股票	55,731,185.41	16.92
2	固定收益投资	35,386,158.60	10.74
	其中:债券	35,386,158.60	10.74
	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	220,121,860.35	66.82
7	其他各项资产	18,185,490.72	5.52
8	合计	329,424,695.08	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,134,177.20	3.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,751,832.00	3.28
E	建筑业	18,487,731.77	5.64
F	批发和零售业	222,304.44	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	8,494,332.00	2.59
H	住宿和餐饮业	6,640,808.00	2.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,731,185.41	17.00

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票投资组合。

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	600502	安徽水利	1,352,431	18,487,731.77	5.64
2	600168	武汉控股	984,600	10,751,832.00	3.28
3	600026	中海发展	919,300	8,494,332.00	2.59
4	600754	锦江股份	129,400	6,640,808.00	2.03
5	002246	北化股份	328,090	4,632,630.80	1.41
6	600038	中直股份	61,700	3,253,441.00	0.99
7	300140	启源装备	130,446	3,248,106.40	0.99
8	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.07

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	600787	中储股份	42,693,235.12	66.89
2	600037	歌华有线	38,859,562.15	60.88
3	600185	格力地产	36,494,526.29	57.18
4	600332	白云山	31,635,216.40	49.56
5	601688	华泰证券	29,988,613.85	46.98
6	000410	沈阳机床	25,066,185.22	39.25
7	000623	广州浪奇	22,990,017.93	36.02
8	600502	安徽水利	21,415,832.73	33.55
9	000090	天健集团	20,577,916.20	32.24
10	600000	浦发银行	20,091,477.44	31.48
11	600118	中国卫星	20,007,907.96	31.35
12	000039	中集集团	19,511,351.67	30.57
13	600270	外运发展	19,003,589.50	29.77
14	600046	泛海控股	18,957,154.92	29.70
15	002673	西部证券	17,748,645.20	27.81
16	002664	信质电机	16,999,842.76	26.63
17	600005	武钢股份	16,964,263.52	26.58
18	600060	海信电器	16,915,857.67	26.50
19	600761	安徽合力	16,733,504.81	26.22
20	000728	国元证券	16,552,178.25	25.93
21	600688	上海石化	16,207,317.00	25.39
22	601991	大唐发电	15,739,589.21	24.66
23	601377	兴业证券	15,466,366.07	24.23
24	000673	当代东方	14,170,808.00	22.20
25	600581	八一钢铁	13,980,518.92	21.90
26	002407	多氟多	13,794,223.44	21.61
27	600168	武汉控股	13,526,687.52	21.19
28	600176	中国巨石	13,306,142.38	20.89
29	600895	张江高科	13,241,570.00	20.75
30	000923	河北宣工	13,211,580.97	20.70
31	601607	上海医药	13,087,569.49	20.50
32	600582	天地科技	13,029,251.04	20.41
33	000001	平安银行	12,996,130.00	20.36
34	601988	中国银行	12,743,726.00	19.97
35	000547	航天发展	12,735,254.69	19.95
36	002208	合肥城建	12,733,228.03	19.95
37	601901	方正证券	12,695,638.45	19.89
38	601211	国泰君安	12,590,142.22	19.72
39	601800	中国交建	11,376,479.39	17.82
40	300274	阳光电源	11,010,530.27	17.25
41	600151	航天机电	10,913,593.43	17.10
42	002322	雅工股份	10,846,021.19	16.99
43	600021	上海电力	10,781,850.39	16.89
44	600900	长江电力	10,561,374.50	16.55
45	600958	东方证券	10,490,641.72	16.44
46	000002	万 科A	10,485,998.80	16.43
47	600549	厦门钨业	10,430,651.80	16.34
48	000151	中成股份	10,360,576.76	16.23
49	000530	大冶股份	10,269,181.00	16.14
50	600050	中国联通	10,278,931.80	16.10
51	600598	北大荒	10,208,000.56	15.99
52	600009	上海机场	10,136,141.60	15.88
53	601939	建设银行	10,109,174.68	15.84
54	601318	中国平安	10,060,533.69	15.76
55	600026	中海发展	9,936,321.77	15.57
56	300297	欣旺达	9,934,750.13	15.56
57	300140	启源装备	9,836,721.70	15.41
58	600343	航天动力	9,811,030.40	15.37
59	002066	瑞泰科技	9,767,065.16	15.30
60	600570	恒生电子	9,703,286.75	15.20
61	600876	洛阳玻璃	9,701,182.36	15.20
62	300033	同花顺	9,281,447.00	14.54
63	600420	现代制药	9,180,084.00	14.38
64	000732	泰禾集团	8,461,118.42	13.26
65	600410	华胜天成	8,394,567.98	13.15
66	002657	中科金财	7,744,713.74	12.13
67	002184	海得控制	7,636,966.00	11.96
68	600679	天坛医	7,621,863.00	11.94
69	601888	中国国旅	7,206,589.96	11.29
70	002339	积成电子	7,078,002.00	11.09
71	000401	冀东水泥	7,032,086.78	11.02
72	000786	北新建材	7,002,334.76	10.97
73	000006	深振业A	6,918,698.50	10.84
74	601088	中国神华	6,917,138.58	10.84
75	000859	国风塑业	6,888,627.71	10.79
76	002251	步 步 高	6,849,791.68	10.73
77	601311	骆驼股份	6,807,729.15	10.67
78	300278	华昌达	6,781,620.76	10.62
79	600219	南山铝业	6,775,206.51	10.61
80	600884	珠江实业	6,736,703.54	10.55
81	601601	中国太保	6,735,090.65	10.55
82	002187	广百股份	6,682,335.95	10.47
83	600663	陆家嘴	6,674,456.59	10.46
84	600754	锦江股份	6,610,900.20	10.36
85	002053	云南盐化	6,505,313.93	10.19
86	600148	长春一东	6,451,495.08	10.11
87	600391	成发科技	6,411,213.00	10.04
88	300059	东方财富	6,369,456.50	9.98
89	002246	北化股份	6,278,509.27	9.84
90	002373	千方科技	6,213,396.34	9.73
91	300168	万达信息	5,881,014.09	9.21
92	000158	常山股份	5,844,957.72	9.16
93	300085	银之杰	5,844,282.25	9.16
94	002358	森源电气	5,678,647.83	8.90
95	300377	赢时胜	5,444,444