诺安研究精选股票型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2016年3月30日

§1 重要提示

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。

基金托管人交通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、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

诺安研究精选股票型证券投资基金和诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“诺安中小板等权重ETF联接基金”)基金份额持有人大会于2015年1月27日至2015年2月26日期间以通讯方式通过的《关于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型有关事项的议案》,并经中国证监会证监许可【2015】489号文予基于诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金变更注册的核准,由诺安中小板等权重ETF联接基金转型而来。

本报告所载内容摘要自年度报告正文,投资者做了解详细内容,应阅读年度报告正文。

自2015年3月30日起诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金转型为诺安研究精选股票型证券投资基金。诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金本报告期自2015年1月1日起至2015年3月29日止。诺安研究精选股票型证券投资基金本报告期自2015年3月30日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	诺安中小板等权重ETF联接
基金主代码	320022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月10日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,920,114.67份
基金合同存续期(若有)	不定期

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	诺安研究精选股票
基金主代码	320022
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月30日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,113,397,636.28份
基金合同存续期(若有)	不定期

2.2 基金产品说明(转型前)

投资目标	通过跟踪大部分基金财产投资于中小板等权重ETF,密切跟踪业绩比较基准,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为中小板等权重ETF的联接基金,主要通过投资于中小板等权重ETF以求达到投资目标。当本基金中期跟踪和广一指中证金中小板等权重ETF或本基金日身份中期跟踪时本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或预期业份投发市跟踪误差时,本基金将视市场情况进行调整,降低跟踪偏差。
业绩比较基准(若有)	中小板等权重指数收益率×95%+活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征(若有)	本基金为中小板等权重ETF的联接基金,风险与预期收益水平高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时,本基金为指数型基金,主要通过投资于中小板等权重ETF来实现对业绩比较基准的表现偏离,因此,本基金的收益表现与中小板等权重指数及中小板等权重ETF的表现密切相关。

2.2 基金产品说明(转型后)

投资目标	本基金通过深入研究挖掘具有长期发展潜力的行业和上市公司,分享其在中国经济增长的大背景下将长期持续增长,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、融资融券投资策略、股票期权投资策略、存款利息收益策略。1.资产配置策略:本基金将根据国家宏观经济政策、证券市场发展状况、国内外经济形势、证券市场估值水平、市场利率水平、市场流动性等因素,结合国家宏观经济政策、证券市场发展状况、国内外经济形势、证券市场估值水平、市场利率水平、市场流动性等因素,在保证一定风险前提下,实现基金资产的长期稳定增值。2.股票投资策略:本基金依托基金管理人的研究平台,遵循科学、系统的研究方法和投资理念,研究公司的基本面,发掘企业价值的核心驱动因素,优选个股。3.债券投资策略:本基金将通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率因素的重要因素进行深入研究,结合债券发行人的信用状况、债券收益率曲线、债券收益率利差、债券收益率曲线形状等因素的变化,以期实现组合稳定收益的目的。4.资产支持证券投资策略:本基金依托基金管理人的研究平台,遵循科学、系统的研究方法和投资理念,研究公司的基本面,发掘企业价值的核心驱动因素,优选个股。5.股指期货投资策略:本基金在国内股指期货推出后,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用股指期货与股票现货、债券现货等品种的多种策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。6.股票期权投资策略:本基金在国内股票期权推出后,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用股票期权与股票现货、债券现货等品种的多种策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。7.融资融券投资策略:本基金将根据证券市场的发展情况,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。8.存款利息收益策略:本基金将在保证一定流动性的前提下,通过对银行存款期限结构的合理安排,实现基金资产的稳定增值。9.资产支持证券投资策略:本基金将根据证券市场的发展情况,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。10.中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资策略:本基金将根据中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金的投资策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准(若有)	本基金的业绩比较基准为“沪深300指数(代码:000300)中证全债指数的综合指数,按80%×沪深300指数+20%×中证全债指数”。
风险收益特征(若有)	本基金为股票型基金,风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高的风险收益特征。

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		诺安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	潘嵘彦
	联系电话	0755-83209688	96659
	电子邮箱	info@fundtech.com.cn	tangyy@bankcomm.com
客户服务电话		400-888-8998	96659
传真		0755-83209677	021-62701216

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.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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1月1日-2015年12月31日		2014年	2013年
	转型前	转型后		
本期已实现收益	1,732,796.73	221,848,350.62	1,620,446.27	6,576,359.11
本期利润	1,462,630.29	258,706,428.37	536,741.19	1,998,277.28
加权平均基金份额本期利润	0.3761	0.1579	0.0859	0.0334
本期基金份额净值增长率	34.89%	18%	17.94%	9.08%
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	0.4243		0.4422	0.2880	0.0041
期末基金资产净值	5,919,471.54	1,133,394,996.96	2,966,791.17	23,507,856.94
期末基金份额净值	1.000	1.018	1.288	1.093

注:上述基金业绩指标不包括持有人交易费的费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注本期公实现收益指基金本期利润扣减本期公允价值变动收益后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注本基金于2015年3月27日(份额折算日)进行了份额折算,基金份额持有人按实持有的每10份诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金折算为1.7273570469份诺安研究精选股票型证券投资基金,折算后基金份额净值为1.000元。

3.2 基金净值表现(转型前)

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

转型前

阶段	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	①-③	②-④
2015年1月1日至2015年3月29日(转型前最后一日)	34.89%	1.24%	43.37%	1.40%	-8.48%	-0.16%
2014年10月1日至2015年3月29日(转型前最后一日)	37.56%	1.25%	40.06%	1.42%	-2.50%	-0.17%
2014年4月1日至2015年3月29日(转型前最后一日)	62.67%	1.11%	77.03%	1.22%	-14.36%	-0.11%
自基金合同生效起至2015年3月29日(转型前最后一日)	73.74%	1.18%	131.26%	1.36%	-57.52%	-0.18%

注:业绩比较基准=95%×中证中小板等权指数收益率+5%×活期存款利率(税后)。

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

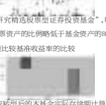
注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金投资于股票资产的比例符合本基金合同规定的各项投资比例的规定。

3.2.3 自基金转型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

注:2015年3月30日(含当日)起,本基金转型为“诺安研究精选股票型证券投资基金”,转型后,本基金的业绩比较基准为:95%×沪深300指数+10%×中证全债指数。

本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金投资于股票资产的比例符合本基金合同规定的各项投资比例的规定。

3.2.4 过去五年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:2015年基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按转型后的本基金实际存续期计算。

3.2.5 过去三年基金的利润分配情况

转型前

本期基金合同于2012年12月10日生效,截止转型前,本基金未进行利润分配。

转型后

2015年3月30日(含当日)起,本基金转型为“诺安研究精选股票型证券投资基金”,转型后,截止2015年12月31日,本基金未进行利润分配。

3.3 其他指标

3.3.1 基金管理人及基金经理情况

3.3.1.1 基金管理人及基金经理情况

截至2015年12月,本基金管理人共管理45只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安信增长混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安积极回报混合型证券投资基金、诺安平稳增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安鑫利混合型证券投资基金、诺安平衡证券投资基金、诺安进取混合型证券投资基金、诺安中证500指数证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优势混合型证券投资基金、诺安和谐混合型证券投资基金、诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安稳健收益一年期开放债券型证券投资基金、诺安鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安先锋分级债券型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安天天宝货币市场基金A级基金、诺安天天宝货币市场基金B级基金、诺安鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安鑫利债券型证券投资基金、诺安鑫利灵活配置混合型证券投资基金、诺安鑫利灵活配置混合型证券投资基金A级基金、诺安鑫利灵活配置混合型证券投资基金B级基金。

3.3.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会成员情况

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		
宋璐婵	上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金基金经理;中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。	2012年12月10日	2015年3月30日	9	经济学博士,具有基金从业资格,曾任招商银行划财务部资产负债管理经理、泰达证券期货经理有限公司风险管理部副总经理、2010年4月加入诺安基金管理有限公司,曾任诺安基金管理有限公司风险管理部总经理、2012年12月至2015年3月任诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、2012年12月至2015年3月任诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理和诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理、2012年12月起任中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注:上证交易型开放式指数证券投资基金基金经理小组:诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理小组。

本报告期内,诺安研究精选股票型证券投资基金基金经理小组成员未发生变动。

注本报告期内,基金经理小组成员未发生违法违规、基金合同、托管协议、招募说书违规履行了投资管理职责的情况。

3.3.1.3 公平交易制度和执行情况

报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《诺安研究精选股票型证券投资基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度,本基金投资管理未发生违法违规行为。

3.3.1.4 公平交易制度和执行情况

报告期内,公司设立了公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过授权范围的事项,必须通过了统一的投资管理委员会、风险控制委员会等通过该研究管理平台报告,并经董事会、公司总经理等有关决策机构批准后方可进行投资。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价的报价数量大于当时市场可供成交的数量,则按照交易系统中都应当按比例分配的原则,将市场可供成交的数量按照各个投资组合的指令数量,按照比例分配成交数量,并按平均价为各个投资组合进行成交。在市场不利情况下,如果中间价格相同,则根据中间价格所在的买卖价差的大小,将市场可供成交的数量分配给中间价格与市场可供成交价格差距较大的一方。

3.3.1.5 公平交易制度的实施情况

报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。此外,公司对连续四个季度期间内,公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内同向反向交易的交易价差进行了分析,未发现同向交易价差在上述时间窗口内出现异常的情况。

3.3.1.6 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易或交较少的单边交易量不存在超过证券当日成交量的5%的情况。

3.3.1.7 管理人对报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

3.3.1.7.1 报告期内基金投资策略和业绩分析

本基金是指数基金,投资目标是:追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。报告期内,本基金主要通过投资于中小板等权重ETF来实现对业绩比较基准的跟踪,并且不断优化组合结构,力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金在报告期内,根据国家宏观经济政策、证券市场发展状况、国内外经济形势、证券市场估值水平、市场利率水平、市场流动性等因素,结合国家宏观经济政策、证券市场发展状况、国内外经济形势、证券市场估值水平、市场利率水平、市场流动性等因素,在保证一定风险前提下,实现基金资产的稳定增值。

1.资产配置策略

本基金依托基金管理人的研究平台,遵循科学、系统的研究方法和投资理念,研究公司的基本面,发掘企业价值的核心驱动因素,优选个股。

2.股票投资策略

本基金依托基金管理人的研究平台,遵循科学、系统的研究方法和投资理念,研究公司的基本面,发掘企业价值的核心驱动因素,优选个股。

3.债券投资策略

本基金将通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率因素的重要因素进行深入研究,结合债券发行人的信用状况、债券收益率曲线、债券收益率利差、债券收益率曲线形状等因素的变化,以期实现组合稳定收益的目的。

4.资产支持证券投资策略

本基金依托基金管理人的研究平台,遵循科学、系统的研究方法和投资理念,研究公司的基本面,发掘企业价值的核心驱动因素,优选个股。

5.股指期货投资策略

本基金在国内股指期货投资资产,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用股指期货与股票现货、债券现货等品种的多种策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。

6.股票期权投资策略

在股票产品推出交易后,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用股票期权与股票现货、债券现货等品种的多种策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。

7.融资融券投资策略

本基金将在国内股票期权推出后,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用股票期权与股票现货、债券现货等品种的多种策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。

8.存款利息收益策略:本基金将在保证一定流动性的前提下,通过对银行存款期限结构的合理安排,实现基金资产的稳定增值。

9.资产支持证券投资策略:本基金将根据证券市场的发展情况,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。

10.中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资策略:本基金将根据中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金的投资策略,在有效控制基金资产的系统性风险的前提下,实现基金资产的稳定增值。

3.3.1.8 报告期内基金投资组合的业绩表现

本报告期内,诺安研究精选股票型证券投资基金净值表现为:34.89%,同期业绩比较基准收益率为:43.37%,报告期内,本基金实现利润1,462,630.29元,期末可供分配利润0.4243元,期末基金份额净值1.018元。

3.3.1.9 管理人对报告期内基金公允价值变动的说明

报告期内,本基金根据《诺安基金管理有限公司关于公允价值变动的说明》,对证券投资品种的公允价值进行了合理的估值,并在报告期内对公允价值变动情况进行了说明。

3.3.1.10 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.11 报告期内基金资产组合情况

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.期初所有者权益(基金净值)	2,284,856.77	660,940.50
2.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	1,462,630.29	1,462,630.29
3.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)	1,112,689.93	388,360.15
其中:1.基金申购款	12,324,977.62	5,171,047.82
2.基金赎回款	-11,112,287.69	-4,782,687.67
4.本期末所有者权益(基金净值)	3,407,540.60	2,511,930.94

注:本报告期内,诺安研究精选股票型证券投资基金净值表现为:34.89%,同期业绩比较基准收益率为:43.37%,报告期内,本基金实现利润1,462,630.29元,期末可供分配利润0.4243元,期末基金份额净值1.018元。

3.3.1.12 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.13 报告期内基金资产组合情况

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.期初所有者权益(基金净值)	2,284,856.77	660,940.50
2.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	1,462,630.29	1,462,630.29
3.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)	1,112,689.93	388,360.15
其中:1.基金申购款	12,324,977.62	5,171,047.82
2.基金赎回款	-11,112,287.69	-4,782,687.67
4.本期末所有者权益(基金净值)	3,407,540.60	2,511,930.94

注:本报告期内,诺安研究精选股票型证券投资基金净值表现为:34.89%,同期业绩比较基准收益率为:43.37%,报告期内,本基金实现利润1,462,630.29元,期末可供分配利润0.4243元,期末基金份额净值1.018元。

3.3.1.14 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.15 报告期内基金资产组合情况

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.期初所有者权益(基金净值)	2,284,856.77	660,940.50
2.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	1,462,630.29	1,462,630.29
3.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)	1,112,689.93	388,360.15
其中:1.基金申购款	12,324,977.62	5,171,047.82
2.基金赎回款	-11,112,287.69	-4,782,687.67
4.本期末所有者权益(基金净值)	3,407,540.60	2,511,930.94

注:本报告期内,诺安研究精选股票型证券投资基金净值表现为:34.89%,同期业绩比较基准收益率为:43.37%,报告期内,本基金实现利润1,462,630.29元,期末可供分配利润0.4243元,期末基金份额净值1.018元。

3.3.1.16 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.17 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.18 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.19 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.20 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.21 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.22 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.23 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.24 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.25 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.26 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.27 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.28 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.29 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.30 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.31 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.32 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.33 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-	-
4.其他投资收益	-	-
5.其他收入	1,732,796.73	221,848,350.62
6.其他费用	1,732,796.73	221,848,350.62
7.利润总额	1,462,630.29	258,706,428.37

3.3.1.34 报告期内基金利润构成

项目	本期 2015年1月1日至2015年3月29日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
1.债券投资收益	1,732,796.73	221,848,350.62
2.股票投资收益	1,462,630.29	258,706,428.37
3.衍生工具投资收益	-