

(二〇一五年第一号)

4、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末指数投资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	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(%)
---	------	------	-------	---------	--------------

序号	股票名称	收盘价(元)	持仓市值(元)	持仓市值占基金资产净值比例(%)
1	300144 华谊演艺	68.70	3,952,908.00	1.27
2	600645 中潜股份	51.20	3,114,706.00	1.00
3	600815 海螺水泥	20.20	3,305,181.20	1.06
4	600426 华鲁恒升	35.50	3,307,560.00	1.05
5	600141 兴发集团	16.90	3,081,776.00	0.99
6	600201 江苏集团	50.36	2,824,672.40	0.91
7	002244 滨江集团	295.60	2,739,800.00	0.87
8	300059 东方财富	30.40	2,640,150.80	0.85
9	600826 鲁泰股份	195.80	2,539,106.00	0.82
10	002299 东兴农业	136.20	2,443,786.80	0.79

2. 报告期内期末投资的前十名股票中,基金资产持仓比例大于1%的上市公司名称及其持仓比例

股票名称	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
------	------	-------	---------	--------------

1	600682	南京百基	62,800	1,845,064.00	0.59
2	600887	伊泰股份	58,300	1,796,555.00	0.58
3	002230	金龙科技	69,400	1,703,964.00	0.55
4	600585	海螺水泥	68,200	1,559,972.00	0.50
5	600073	梅花生物	162,500	1,444,625.00	0.46

7. 报告期内买入或卖出公允价值低于50万元的投资证券情况

注：本基金本报告期末未持有债券。

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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注：本基金本报告期末未投资股指期货。

(2) 本基金投资于股票资产的比例为股票资产。

本基金根据基金合同约定的投资范围, 投资于股票资产时, 应遵守下列规定:

1、报告期内本基金投资的股票期限不得超过投资说明说明

(1) 本期应投资于股票资产

本基金根据基金合同约定的投资, 不允许投资于股票期限。

(2) 报告期内本基金投资的股票期限特性和跟踪时间

注: 本基金投资于股票资产期限不得超过投资说明说明

(3) 本期应投资于股票资产

本基金根据基金合同约定的投资, 不允许投资于股票期限。

2、投资组合合规性说明

(1) 申报本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资于股票资产时, 应遵守下列规定:

(2) 申报本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

(3) 申报基金投资的前十名证券是否超越基金合同约定的投资范围

(4) 申报基金投资的前十名证券中是否有在基金合同约定投资范围之外的股票。

(3) 其他资产投资情况

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,234.77
2	应收证券清算款	--
3	应收利息	--
4	应收股利	4,957.38
5	应收申购款	--
6	其他资产	9,134,192.87

7	待摊费用		-	-		
8	其他		-	-		
9	合计		9,187,385.22			
(4) 报告期内未持有及转让收购的股权转换券明细 注：本基金在报告期内未持有及转让收购的股权转换券。						
(5) 报告期内前十名资产中不存在流通受限情况说明 ①报告期内前十名资产中不存在流通受限资产的说明						
金额单位：人民币元						
序号	股票代码	股票名称	期末公允价值占基金净资产公允价值的比例(%)	流通受限情况说明		
1	300069	东方财富	2,040,150.80	0.85 限售重大事件		
②报告期内前十名资产中不存在流通受限资产的情况 注：本基金在报告期内前十名资产中不存在流通受限资产情况。 ③报告期内前十名资产中不存在流通受限资产的情况 因购入人违约，投资组合估值中资产与净值占比的分布之与持仓可存在差异。 本基金管理人依据估值原则，采用公允价值，谨慎确定投资组合的公允价值并运用其计算收益，但不保证基金净值准确。由于基金份额持有人申购赎回行为导致基金份额净值波动，基金份额净值并不代表其未来表现。投资者有风险，投资人应自主投资决策并承担相应投资风险为本基金的申购风险。 ④报告期内50指数跟踪误差率及证券投资组合（LOF）历史不同时间段跟踪误差率与同期业绩比较基准收益率对比表						
阶段	净值增长①	净值增长率差②	年化收益比率③	年化跟踪误差④	①-③	②-④
2011.10.12~2012.11.31	-15.10%	1.33%	-13.54%	1.65%	-1.56%	-0.32%
2012.12.1~2013.1.31	7.77%	0.29%	1.41%	1.46%	6.36%	-0.01%
2013.1.31~2013.12.31	16.47%	1.80%	17.29%	1.37%	-0.67%	0.01%
2014.1.1~2014.12.31	38.71%	1.14%	38.23%	1.18%	0.48%	-0.04%
2015.1.1~2015.3.31	37.77%	1.25%	34.54%	1.28%	3.23%	-0.03%
2015.1.1~2014.12.31	103.90%	1.33%	91.27%	1.37%	12.63%	-0.04%
注：①基金净值增长率以人民币资产净值50指数跟踪误差率（LOF）累计跟踪误差率与同期业绩比较基准收益率对比表为趋势分析图						

注:1截止日期为2016年10月31日
2截止期为2011年10月12日成立,建仓期6个月,从2011年10月12日起至2012年11月1日,建仓期未满6个月的部分,建仓期未满6个月期间,按照建仓期比例扣减基金管理费,7-12月期间,按照7-12月期间比例扣减基金管理费。

(一)与基金业务有关的费用

1.基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费;

(2)基金托管人的托管费;

(3)基金应收的款项信息披露费用;

(4)基金上市初费及维持费;

(5)基金申购时有人大费支出;

(6)基金应收的款项与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费;

(7)基金的证券交易费用;

(8)基金的指数使用费;

(9)基金财产审计的会计师事务所费用;

(10)证券账户开户费用和银行汇划费支出;

(11)按照国家有关规定和基金合同约定,基金管理人可以在基金财产中扣除的其他费用。

上述基金费用由基金托管人从基金财产中按照公告的市价价格扣除,法律法规和基金合同另有规定则从其规定。

2.基金费用的计提方法

(1)基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$H = R \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$, 本基金年管理费率暂为3%

H为每日应计提的基金管理费

逐日计提,按月支付。

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付时,顺延至最近可支付日支付。

(2)基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

$H = R \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$, 本基金年托管费率暂为0.15%

H为每日应计提的基金托管费

逐日计提,按月支付。

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付时,顺延至最近可支付日支付。

(3)基金的指数使用费

基金管理人根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议中约定的指数和指数编制公司的公示的指数使用费费率,按前次计提的基金资产净值的0.01%计提使用费,使用费逐月支付。

计算方法如下:

$H = R \times 0.01\%$, 当年天数

H为每日应计提的指数使用费

逐日计提,按月支付。

指数使用费由基金管理人向中证指数有限公司支付人民币5元/月。

由于中证指数有限公司调整费率或变更指数使用费的权利,如果指数使用费的计算方法、费率标准和支付方式,基金基金托管人调整后,基金管理人应相应调整。

(4) 上述一、二款所引的法律法规由基金管理人根据其他有关法律法规及相应协议的规定, 按费用(或支出)占基金资产净值的比例计提。

(5) 与基金运作无关的费用

1. 申购费

(1) 本基金的申购费率为申购金额的 1.5%。

投资者选择申购本基金或赎回本基金时交纳申购费用。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费, 投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费。

(2) 投资者选择交纳的前端申购费用, 申购金额全部计入净申购金额。

本基金的申购费通过对支付到申购的净基金份额的净基金份额占申购此之外的其他投资者实施差别费率。

A. 前端申购费率

申购金额(含申购费)	前端申购费率
100 元以内	1.5%
100 元以上—500 元	1.2%
500 元以上—1000 元	1.0%
1000 元以上	0.8%

注: 上述前端申购费率适用于通过本公司直销柜台申购的投资者; 基金客户外的其他选择前端收费模式的投资者。

确定金额(M, 基金收费)	确定申购费率
M<100元	0.45%
100元≤M≤500元	0.30%
500元≤M	每笔100元

注：1. 上述申购费率适用于本公司直销申购，以前端收费模式申购的基金份额，其申购基金费率将与该基金份额对应的资产计划申购的资产计划及投资运作形成的收益对应的申购基金费率，在扣除申购基金管理人应收申购基金费用后，计入该基金份额持有人申购基金资产计划计划收益及集合计划收益；2. 申购基金资产计划计划收益及集合计划收益，在扣除申购基金管理人应收申购基金费用后，计入该基金份额持有人申购基金资产计划计划收益及集合计划收益；3. 如将来出现新的申购基金费率，以新的申购基金费率类型，本公司将在招募说明书更新或修改招募说明书公告及销售公告中披露，并将在申购时以销售公告为准。

2. 投资者申购基金份额申购费用，按申购金额采用比例费率，费率按持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	申购申购费率
1年以内(含)	1.6%
1年~3年(含)	1.0%
3年~5年(含)	0.9%
5年以上	0

3. 申购费用和赎回费用计入基金资产，以基金资产为基数，按以下比例计提和根据投资渠道不同将费用在申购和赎回时收取，具体情况以基金合同及交易所相关规定为准。

(2) 本基金基金的申购费用由基金资产承担，赎回费用归基金份额持有人所有，主要用于支付基金的销售、注册登记等各项费用，赎回费用归基金管理人所有。

3. 赎回费率

本基金赎回费率为投资者申购时确定的赎回费率。

投资者持有基金份额的时间越长，赎回费率越低，赎回费率最低为0.5%。

投资者赎回基金份额赎回费用，以赎回基金份额的赎回费率，赎回基金份额持有时间递减，具体费率如下：

持有时间	赎回费率
2年以内(含)	0.65%
2年~3年(含)	0.3%
3年以上	0

4. 投资者申购和赎回基金份额的申购费、赎回费由基金资产承担。本基金申购费用和赎回费用在投资者申购和赎回基金份额时收取，计入用于市场费用。

5. 投资者申购和赎回基金份额的申购费、赎回费由基金资产承担，赎回费用归基金份额持有人所有，主要用于支付基金的销售、注册登记等各项费用，赎回费用归基金管理人所有。

[illegible]
