国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安中债信用债指数增强
基金主代码	253070
交易代码	253070
基金运作方式	契约型、开放式、发起式
基金合同生效日	2012年12月12日
报告期末基金份额总额	43,860,182.94份
投资目标	本基金力争把债券资产的投资组合的平均剩余期限控制在中债信用债总财富(3-5年)指数成分券的平均剩余期限内,在控制信用风险的前提下,精选备选成分券及样本外债券,将跟踪误差控制在一定范围之内并力争取得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将对中债信用债总财富(3-5年)指数采取抽样复制为主、增强投资为辅的方式进行投资,通过将投资组合成分券的平均久期、信用等级结构等特征保持在类似于中债信用债总财富(3-5年)指数成分券组合的平均久期、信用等级结构等对应特征的水平,以求获得与中债信用债总财富(3-5年)指数收益率高度相关的收益特性,并在此基础上追度调整,结合数量化投资技术、个券深入研究、利率市场走势判断等,谋求基金投资组合在严格控制偏离风险及力争获得适度超额收益间的最佳匹配。
业绩比较基准	95%×中债信用债总财富(3-5年)指数收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属较低风险品种,预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,534,025.16
2.本期利润	2,164,247.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.0445
4.期末基金资产净值	49,367,337.40
5.期末基金份额净值	1.126

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

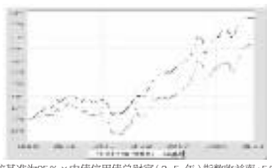
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	4.16%	0.13%	3.06%	0.10%	1.10%	0.03%

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2自基金合同生效以来基金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

国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月12日至2015年6月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为95%×中债信用债总财富(3-5 年)指数收益率+5%×活期存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2012年12月12日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,建仓期结束时各项资产配置符合合同约定;

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
薛琳	本基金基金经理、兼任国联安货币市场证券投资基金基金经理、国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2012-12-12	-	9年(自2006年起)	薛琳女士,管理学学士,2006年3月至2006年12月在上海红顶金融研究中心公司担任项目管理工作。2006年12月至2008年6月在上海国利货币有限公司担任债券交易员。2008年6月至2010年6月在上海长江券老保险股份有限公司担任债券交易员。自2010年6月起,加盟国联安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、债券组合管理部基金经理助理。2012年7月起担任国联安货币市场证券投资基金基金经理。2012年12月起兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理。2015年6月起兼任国联安鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
李广瑜	本基金基金经理、兼任国联安德盛增利债券型证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理、国联安保本混合型证券投资基金基金经理、国联安睿棋灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2015-03-30	-	6年(自2009年起)	李广瑜先生,硕士研究生,注册金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM)。2005年1月至2006年8月在融星资讯有限公司担任分析师;2006年9月至2009年8月在渣打银行有限责任公司担任国际管理培训生;2009年9月至2011年8月在海富通基金管理有限公司担任债券投资经理,2011年8月至2013年6月在太平资产管理有限公司担任债券投资经理。2013年6月起加入国联安基金管理有限公司。2013年11月起担任国联安德盛增利债券证券投资基金基金经理。2013年12月起兼任国联安信心增长债券型证券投资基金基金经理。2015年3月起兼任国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金经理,2015年6月起兼任国联安睿棋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015年6月起兼任国联安信心增益债券型证券投资基金基金经理。2015年6月起兼任国联安保本混合型证券投资基金基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

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》、《国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章,制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称"公平交易制度"),用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会;在交易环节严格按照时间优先,价格优先的原则执行指令;如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

本报告期内,公司旗下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未发现有超过该证券当日成交量5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

相比于1季度的低迷,2季度中采PMI持续位于荣枯线以上,6月份录得50.2%,显示出稳增长措施或取得一定成效,但判断经济已经企稳为时尚早,在经济不见明显复苏,通胀徘徊在低位的情况下,央行在货币政策上有了更多的操作空间。这既有全面的降息、降准,还有定向的宽松,同时也一再下调公开市场逆回购利率。因此,即使在地方债的影响下,过去3个月债市依然取得了较好的表现。未来看,经济和通胀构筑的债市基本面仍在;货币政策的宽松格局也将大概率保持,只是方式上可能更多从全面向定向过渡,即着眼于经济而非单纯的流动性;另外,下半年财政政策或在稳增长方面扮演更重要的角色。综合来看,债市未来走势或更加均衡,收益率大幅波动的概率不大,票息带来的持有期收益还是较为确定的。

本基金仍将密切跟踪按照中债信用债3-5年指数,根据成分券进行配置,在市场向好时择机增加杠杆和选择久期,力争取得比指数更好的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为4.16%,同期业绩比较基准收益率为3.06%。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	76,054,000.00	94.06
	其中:债券	76,054,000.00	94.06
	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	3,461,036.98	4.28
7	其他各项资产	1,340,836.22	1.66
8	合计	80,855,873.20	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	45,720,000.00	92.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,334,000.00	61.45
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	76,054,000.00	154.06

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项存在尾差。

5.5 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	1382071	13津高路MTN1	200,000	20,224,000.00	40.97
2	124142	13渝三峡	200,000	20,110,000.00	40.74
3	112154	12盐湖01	100,000	10,287,000.00	20.84
4	122259	13中信01	100,000	10,238,000.00	20.74
5	1382041	13渝高科MTN1	100,000	10,110,000.00	20.48

5.6 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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除13中信01外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

13中信01(122259)的发行主体中信证券股份有限公司于2015年1月19日发布公告称,因存在为到期融资融券合约展期的问题被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,854.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,170,318.05
5	应收申购款	166,663.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,340,836.22

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	57,633,755.57
本报告期基金总申购份额	924,807.62
减:本报告期基金总赎回份额	14,698,380.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	43,860,182.94

注:总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额;总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

本报告期期初基金份额总额	10,001,100.00
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,100.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	22.80

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,100.00	22.80%	10,001,100.00	22.80%	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,100.00	22.80%	10,001,100.00	22.80%	-

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会批准国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金基金合同》

3、《国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》

4、《国联安中债信用债指数增强型发起式证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

9.2存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦9楼

9.3查阅方式

网址:www.gtja-allianz.com或www.vip-funds.com

国联安基金管理有限公司
二〇一五年七月二十一日

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:国联安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国联安股债动态
基金主代码	000060
交易代码	000060
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月26日
报告期末基金份额总额	4,405,035.73份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过6%,努力实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金进行被动式指数化投资。其中,除应对赎回所必需的现金类资产之外,其余基金资产严格按照标的指数中股票类资产与债券类资产的比例进行配置。
业绩比较基准	95%×中证股债动态合成期权策略指数收益率+ 5% ×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	1,008,502.41
2.本期利润	634,134.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.1154
4.期末基金资产净值	6,018,422.43
5.期末基金份额净值	1.366

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,例如,开放式基金的申购赎回费等,计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

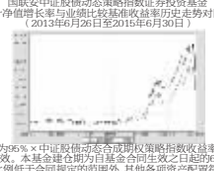
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	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	3.88%	2.39%	6.85%	2.34%	-2.97%	0.05%

注:上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2.2自基金合同生效以来基金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

国联安中证股债动态策略指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年6月26日至2015年6月30日)



注:1、本基金业绩比较基准为95%×中证股债动态合成期权策略指数收益率+ 5%×活期存款利率(税后);

2、本基金基金合同于2013年6月26日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月,2013年12月25日建仓期结束当日除中证短融50指数成份券及备选成份券的投资比例低于合同规定的范围外,其他各项资产配置符合合同约定;

3、由于银行间账户开设过程历时较长,2013年12月25日建仓期结束当日尚未完成银行间账户开设,从而导致中证短融50指数成份券及备选成份券的投资比例当日被动未达标;

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理	2013-06-26	-	13年(自2002年起)	黄欣先生,伦敦经济学院会计金融专业硕士,于2002年11月加入兴业证券投资部任投资分析员,于2003年10月加入国联安基金管理有限公司,历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、投资组合管理部债券投资助理、国联安德盛精选股票证券投资基金及国联安德盛安心混合型证券投资基金基金经理助理。2010年4月起担任国联安双禧中证100指数分级证券投资基金基金经理,2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金基金经理,2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理,2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理,2013年6月起兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金经理。

注:1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

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》、《国联安中证股债动态策略指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在严格控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章,制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称"公平交易制度"),用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内,本基金管理人严格执行公平交易制度的规定,公平对待不同投资组合,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会;在交易环节严格按照时间优先,价格优先的原则执行指令;如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时,及时执行交易系统中的公平交易模块;采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析;对投资流程独立稽核等。

本报告期内,公司旗下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未发现有超过该证券当日成交量5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在宽松的货币政策支持之下,过去1年股市经历了大幅度的上涨,2015年2季度,股市先扬后抑,季度末出现较大幅度的调整,沪深300从最高点回调超过15%,创业板指回调超过29%。从整个2季度来看,沪深300指数上涨10.41%。从沪深300指数的各个板块表现来看,2季度军工、航空、电力等行业表现较好,证券、保险、银行等行业表现较差。

依据基金合同的约定以及指数仓位的计算规则,本基金保持合理的仓位,股票部分采用完全复制的方法跟踪沪深300指数,将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.366元,本报告期份额净值增长率为3.88%,同期业绩比较基准收益率为6.85%。本报告期内,日均跟踪偏离度为0.11%,年化跟踪误差为2.54%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.5%,以及年化跟踪误差不超过6%的限制。

4.5报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内,本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况,出现该情况的时间范围为2015年1月5日-2015年6月30日。

基金管理人拟加大营销力度,提升基金规模。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,465,232.07	87.44
	其中:股票	5,465,232.07	87.44
2	固定收益投资	200,244.90	3.20
	其中:债券	200,244.90	3.20
	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	452,729.01	7.24
7	其他各项资产	131,954.15	2.11
8	合计	6,250,160.13	100.00

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,999.40	0.22
B	采矿业	248,162.43	4.12
C	制造业	1,840,128.68	30.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	231,086.13	3.84
E	建筑业	239,138.24	3.97
F	批发和零售业	115,784.77	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	228,122.89	3.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	308,766.13	5.13
J	金融业	1,817,015.50	30.19
K	房地产业	217,760.40	3.62
L	租赁和商务服务业	55,074.34	0.92
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	46,861.29	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,387.42	0.09
R	文化、体育和娱乐业	68,685.10	1.14
S	综合	14,382.86	0.24
	合计	5,449,355.58	90.54

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项存在尾差。

5.2.2积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,414.51	0.07
C	制造业	6,548.43	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,795.39	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
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	1,118.16	0.02
S	综合	-	-
	合计	15,876.49	0.26

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项存在尾差。

5.3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

5.3.1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	601318	中国平安	2,570	210,585.80	3.50
2	600036	招商银行	7,810	146,203.20	2.43
3	600016	民生银行	10,513	104,499.22	1.74
4	600030	中信证券	3,726	100,266.66	1.67
5	601166	兴业银行	5,370	92,632.50	1.54
6	600000	浦发银行	5,303	89,938.88	1.49
7	601988	中国银行	17,495	85,550.55	1.42
8	600837	海通证券	3,824	83,363.20	1.39
9	601766	中国南车	4,333	79,553.88	1.32
10	601328	交通银行	9,301	76,640.24	1.27

5.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600395	盘江股份	281.00	4,414.51	0.07
2	002416	爱施德	114.00	2,390.58	0.04
3	600498	烽火通信	74.00	1,958.04	0.03
4	600058	五矿发展	43.00	1,404.81	0.02
5	600267	海正药业	73.00	1,371.67	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	198,791.80	3.30
	其中:政策性金融债	198,791.80	3.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,453.10	0.02
8	其他	-	-
9	合计	200,244.90	3.33

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 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	018001	国开1301	1,940	198,791.80	3.30
2	110031	航信转债	10	1,453.10	0.02

5.6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资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货,没有相关投资政策。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,没有相关投资评价。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体中除中国平安、中信证券和海通证券外,没有出现被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

中国平安(601318)的控股子公司中国平安财产保险股份有限公司(以下简称"平安产险")于2014年8月22日收到中国保监会的《行政处罚决定书》,对于平安产险倒卖单导致保费收入、准备金等数据不真实违反《保险法》的行为处以罚款,对于平安产险未执行关于危险单位划分的内控制度与流程、未加强内部管理违反《保险公司管理规定》的行为处以警告并罚款。

中国平安(601318)的控股子公司平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")于2014年12月8日收到中国证监会关于保荐书存在虚假记载的行为、未审慎核查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性的行为违反《证券法》的《行政处罚决定书》,对平安证券给予警告,没收保荐业务收入400万元,没收承销股票违法所得2,867万元,并处以4倍罚款。

中国平安(601318)的控股子公司平安财产保险股份有限公司(以下简称"平安产险")的北京分公司于2015年1月12日收到中国保监会的《行政处罚决定书》,平安产险北京分公司违反了《健康保险管理办法》,被处以警告并罚款。

中国平安(601318)的控股子公司平安资产管理有限责任公司(以下简称"平安资产")于2015年2月2日收到中国保监会的《行政处罚决定书》,平安资产未谨慎处理投资计划事务的行为,构成违规运用保险资金的违法行为,被处以罚款。

中信证券(600030)的发行主体中信证券股份有限公司于2015年1月19日发布公告称,因存在为到期融资融券合约展期的问题被中国证监会采取暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

海通证券(600837)的发行主体海通证券股份有限公司于2015年1月20日发布公告称,因存在违规为到期融资融券合约展期的问题受到中国证监会暂停新开融资融券客户信用账户3个月的行政监管措施。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,187.65
2	应收证券清算款	91,132.12
3	应收股利	-
4	应收利息	5,614.22
5	应收申购款	25,020.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	131,954.15

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600645	中源协和	7,733,800.65	1.64	重大事项停牌
2	002727	一心堂	7,091,026.74	1.50	重大事项停牌