

(上接B018版)					
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	158,885	13,019,036.90	9.13
2	600036	招商银行	484,079	9,061,958.88	6.35
3	600016	民生银行	834,872	8,298,627.68	5.82
4	600030	中信证券	230,843	6,211,985.13	4.36
5	601166	兴业银行	335,258	5,783,200.50	4.05
6	600000	浦发银行	328,336	5,568,561.60	3.90
7	600837	海通证券	237,319	5,173,564.20	3.63
8	601328	交通银行	575,737	4,744,072.88	3.33
9	000002	万科A	284,544	4,131,578.88	2.90
10	601398	工商银行	728,516	3,846,564.48	2.70

1.3.2 报告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
注:本基金本报告期末未进行积极投资。
1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券。
1.5 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
注:本基金本报告期末未持有债券。
1.6 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
1.7 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
注:本基金本报告期末未持有贵金属。
1.8 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.9 报告期末基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 报告期末基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:报告期末本基金无股指期货持仓。
1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
注:本基金本报告期末未投资股指期货。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.10.1 本期国债期货投资政策
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:报告期末本基金无国债期货持仓。
1.10.3 本期国债期货投资评价
注:本基金本报告期末未投资国债期货。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
1.11.2 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票库。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,682.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	58.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,740.78

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。
1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末未进行积极投资,不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩
本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

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)
2013年8月23日(基金合同生效日至)至2013年12月31日	-11.40%	1.24%	1.13%	1.51%	-12.53%
2014年1月1日至2014年12月31日	88.18%	1.61%	84.95%	1.62%	-0.01%
2015年1月1日至2015年6月30日	7.84%	2.49%	7.76%	2.51%	0.08%
2013年8月23日(基金合同生效日至)至2015年6月30日	79.80%	1.83%	101.56%	1.88%	-21.76%
2015年6月30日	-0.05%	-	-	-	-

(二) 自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图



十三、基金的费用与税收

一、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、基金的标的指数使用许可费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金上市费及年费;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 0.05\% \times \text{当年天数}$

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

基金管理人每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据基金管理人的授权委托书,于次月前2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、公休假日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$

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

标的指数费用按每日报价指数计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金的指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的前一个工作日内就上述标的指数使用许可费费率0.03%。

H 为每日应计提的基金的指数使用许可费

E 为前一日基金资产净值

标的指数费用按每日报价指数计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金的指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的前一个工作日内就上述标的指数使用许可费费率0.03%。

H 为每日应计提的基金的指数使用许可费

E 为前一日基金资产净值

标的指数费用按每日报价指数计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金的指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的前一个工作日内就上述标的指数使用许可费费率0.03%。

标的指数费用按每日报价指数计算,逐日累计,按季支付。由基金管理人向基金托管人发送基金的指数使用许可费划付指令,经基金托管人复核后于每年1月、4月、