海富通中小盘混合型证券投资基金

2015年9月30日

【2015】第三季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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7月1日起至9月30日止。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及有关规定,经基金管理人与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,本基金从2015年8月7日起由"海富通中小盘股票型证券投资基金"更名为"海富通中小盘混合型证券投资基金"。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中小盘混合
基金主代码	519026
交易代码	519026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月14日
报告期末基金份额总额	201,084,228.93份
投资目标	本基金通过投资于具有高成长潜力和良好基本面的中小盘股票,在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等,对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控,在投资范围内确定相应大类资产配置比例;其次通过对行业及个股进行定量与定性相结合的分析,精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘上市公司进行投资。
业绩比较基准	基金业绩比较基准=中证700指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中高风险水平的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-159,112,962.45
2.本期利润	-125,245,979.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5818
4.期末基金资产净值	199,298,028.67
5.期末基金份额净值	0.991

注:(1)所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;

(2)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。

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

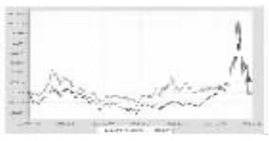
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-35.61%	3.32%	-25.41%	3.11%	-10.20%	0.21%

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

海富通中小盘混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010年4月14日至2015年9月30日)



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十一条(二)、(五)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§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		
黄峰	本基金的基金经理;海富通内需热点混合基金经理;海富通股票混合基金经理;海富通领先成长混合基金经理	2014-12-17	-	5年	硕士。持有基金从业人员资格证书。历任大公国际资信评估公司信用分析部分析师,深圳九富投资顾问有限公司项目部员工,大连獐子岛渔业集团股份有限公司证券部负责人、证券事务代表,华创证券有限责任公司研究所高级研究员。2011年5月加入海富通基金管理有限公司,历任股票分析师、基金经理助理。2014年12月起担任海富通股票混合、海富通中小盘混合、海富通内需热点混合和海富通领先成长混合的基金经理。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准为:自参加证券行业的相关工作开始计算。

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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,没有发生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

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,检验结果表明,在T日、T+3日和T+5日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度,市场整体明显弱势,在股市降杠杆、经济增速放缓、改革不及预期等一系列因素共振下,股票市场在第三季度深度回调。三个月时间,上证综指跌去1200多点,跌幅28.63%,不但抹去了上半年涨幅,还使上证综指前三季度收跌5.62%。而经过第三季度30.34%的暴跌,深证成指前三季度收跌9.32%。

虽然市场赢弱,但并不缺少题材。国防军工、国企改革、互联网金融、计算机、中国制造2025等轮动频繁。资金面上,今年前三季度,央行分别进行了四次降息和降准,市场流动性较为宽裕,但人气涣散,指数方面并没有很好表现。

指数方面,经过6月中至7月初这一轮的暴跌,截止三季度末,上证综指和深证成指涨幅已全部抹除,还分别下跌5.62%和9.32%。而前期涨幅较好的创业板和中小板还分别存有41.51%和24.14%的涨幅。就中信证券一级行业指数而言,截止今年第三季度末,传媒、计算机、轻工制造涨幅都在50%以上,而券商、保险和银行以及传统的煤炭、有色、石油石化等涨幅最后。

三季度,在市场去杠杆进一步深化、人民币贬值担忧、经济增长失速担忧的背景下,本基金大幅降低仓位应对市场系统性风险,同时明显增加防御类资产的配置比例,新兴成长类资产向个别景气子板块与核心品种收缩,改革类资产也进一步精选收缩,核心战略资产保留适当底仓。9月下旬开始不断提高仓位,明显提高了改革类资产与新兴成长类资产的配置比例。

4.5报告期内基金的业绩表现

报告期本基金净值增长率为-35.61%,同期业绩比较基准收益率为-25.41%,基金净值跑输业绩比较基准10.20个百分点,跑输基准的主要原因在于未参与7月份的市场反弹,同时基础性持仓的改革类资产在8月下旬开始补跌明显。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济三季度运行较为疲弱,再加上国内股市波动影响,经济下行压力有所加大。在这个背景下,宏观调控政策加大了稳增长力度,基建项目加码、汽车购置税减免、首套房首付比例下调等举措相继出台,同时货币政策维持宽松。预计宏观经济在四季度有望出现改观,经济、金融运行的风险将得到缓解。

A股市场在三季度经历了大幅调整,对宏观经济的担忧、对汇率和资金问题的不确定均有所反映,杠杆比例高、股票估值贵的问题也得到缓解。考虑到四季度资金面依然宽松、宏观经济有望获得改观,预计四季度A股市场总体风险不大,结构性机会、主题性机会值得持续关注。

本基金四季度的投资策略是:四季度,本基金将加大结构性机会的关注度,相比三季度适当增加乐观度,仍将强调创新与改革两条主线,持续重点关注新兴成长类资产,强化相关领域核心资产的精选力度,持续重点关注改革相关类资产的关注度与精选力度;同时适当灵活关注主题性投资机会。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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	160,111,220.65	79.42
	其中:股票	160,111,220.65	79.42
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	40,106,787.52	19.89
7	其他资产	1,391,112.86	0.69
8	合计	201,609,121.03	100.00

5.2 报告期末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	217,689.55	0.11
C	制造业	109,402,372.80	54.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,635,508.84	2.83
E	建筑业	1,102,827.36	0.55
F	批发和零售业	-	-
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	23,027,047.70	11.55
J	金融业	16,045,857.23	8.05
K	房地产业	4,679,917.17	2.35
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	160,111,220.65	80.34

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

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	600562	国睿科技	372,672	15,581,416.32	7.82
2	002544	杰赛科技	304,137	8,892,965.88	4.46
3	600990	四创电子	118,807	7,146,241.05	3.59
4	600015	华夏银行	690,333	6,979,266.63	3.50
5	002657	中科金财	97,900	5,963,089.00	2.99
6	600343	航天动力	308,800	5,796,176.00	2.91
7	002465	海格通信	448,198	5,723,488.46	2.87
8	000001	平安银行	537,700	5,640,473.00	2.83
9	600886	国投电力	637,501	5,635,508.84	2.83
10	600118	中国卫星	154,492	5,527,723.76	2.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

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

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

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

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的华夏银行(600015)于2015年5月5日公告称,公司收到《中共北京市纪委立案决定书》,中共北京市纪委对本公司副行长王耀庭先生的违纪问题予以立案。

对该股票的投资决策程序的说明:公司半年报中间业务收入受益于理财业务及银行卡业务快速增长而保持高速增长。升息收入受净息差环比下降影响增速放缓,考虑到利率市场化已接近尾声,这部分影响未来将减弱。公司未来看点是与微众签订战略合作协议,在多领域进行合作,推动较为薄弱的零售业务改善。估值较低,安全边际较高。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	972,934.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,722.30
5	应收申购款	408,456.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,391,112.86

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

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	002544	杰赛科技	8,892,965.88	4.46	重大事项
2	600990	四创电子	7,146,241.05	3.59	重大事项

§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	248,864,648.65
本报告期基金总申购份额	75,229,644.63
减:本报告期基金总赎回份额	123,010,064.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	201,084,228.93

§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

本基金本报告期基金管理人未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于2003年4月,是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从2003年8月开始,海富通先后募集成立了32只公募基金。截至2015年9月30日,海富通管理的公募基金资产规模超过313亿元人民币。

作为国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人,截至2015年9月30日,海富通为近80家企业超过387亿元的企业年金基金担任了投资管理人。作为首批特定客户资产管理业务资格的基金管理公司,截至2015年9月30日,海富通旗下专户理财管理资产规模超过103亿元。2010年12月,海富通基金管理有限公司被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012年9月,中国保监会公告确认海富通基金为首批保险资金投资管理人之一。2014年8月,海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理公司正式开业,获准开展特定客户资产管理服务。

2004年末开始,海富通为QFII(合格境外机构投资者)及其他多个海内外投资组合担任投资咨询顾问,截至2015年9月30日,投资咨询及海外业务规模超过108亿元人民币。2011年12月,海富通全资子公司——海富通资产管理(香港)有限公司获得证监会核准批复RQFII(人民币合格境外机构投资者)业务资格,能够在香港筹集人民币资金投资境内证券市场。2012年2月,海富通资产管理(香港)有限公司已募集发行了首只RQFII产品。

海富通同时还在不断践行其社会责任。公司自2008年启动"绿色与希望-橄榄枝公益环保计划",针对汶川震区受灾学校、上海民工小学、安徽老区小学进行了物资捐赠,向内蒙古库伦旗捐建了环保公益林。几年来,海富通的公益行动进一步升级,持续为上海民工小学学生捐献生活物资,并向安徽农村小学捐献图书室。此外,海富通还积极推进投资者教育工作,推出了以"幸福投资"为主题和特色的投资者教育活动,向投资者传播长期投资、理性投资的理念。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准设立海富通中小盘混合型证券投资基金的文件

(二)海富通中小盘混合型证券投资基金基金合同

(三)海富通中小盘混合型证券投资基金招募说明书

(四)海富通中小盘混合型证券投资基金托管协议

(五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

(六)报告期内海富通中小盘混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层本基金管理人办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司
二〇一五年十月二十七日

海富通中证100 指数证券投资基金(LOF)

2015年9月30日

【2015】第三季度报告

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十七日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	海富通中证100 指数(LOF)
场内简称	海富100
基金主代码	162307
交易代码	162307
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月30日
报告期末基金份额总额	160,655,947.03份
投资目标	采用指数化投资方式,通过有效的投资程序约束和数量化风险管理手段,控制基金投资组合相对于业绩比较基准的偏离度,实现对业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制策略,即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	中证100指数×95%+活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
基金管理人	海富通基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	20,434,505.31
2.本期利润	-57,699,655.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3320
4.期末基金资产净值	152,786,752.90
5.期末基金份额净值	0.951

注:(1)所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。

(2)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。

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

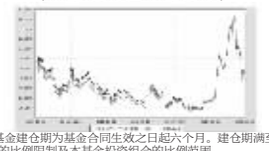
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.06%	3.09%	-25.33%	3.08%	0.27%	0.01%

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

海富通中证100 指数证券投资基金(LOF)

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年10月30日至2015年9月30日)



注:按照本基金合同规定,本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十五条(二)、(七)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

§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		
刘璎	本基金的基金经理;海富通上证周期ETF基金经理;海富通上证周期ETF联接基金经理;海富通上证非周期ETF基金经理;海富通中证内地低碳指数基金经理;指数投资部指数投资负责人	2012-01-20	-	14年	管理学硕士,持有基金从业人员资格证书。先后任职于交通银行、华安基金管理有限公司,曾任华安上证180ETF基金经理助理;2007年3月至2010年6月担任华安上证180ETF基金经理,2008年4月至2010年6月担任华安中国A 股增强指数基金经理。2010年6月加入海富通基金管理有限公司。2010年11月起任海富通上证周期ETF及海富通上证周期ETF联接基金经理。2011年4月起任海富通上证非周期ETF及海富通上证非周期ETF联接基金经理。2012年1月起兼任海富通中证100指数(LOF)基金经理。2012年5月起兼任海富通中证内地低碳指数基金经理。2013年10月起任指数投资部指数投资负责人。

注:1、对基金的首任基金经理,其任职日期指基金合同生效日,离任日期指公司做出决定之日;非首任基金经理,其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

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,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,没有发生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

公司根据证监会2011年发布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的具体要求,持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,涵盖了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时,公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

公司建立了严格的投资交易行为监控制度,公司投资交易行为监控体系由交易室、投资部、监察稽核部和风险管理部组成,各部门各司其职,对投资交易行为进行事前、事中和事后的全程监控,保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内,公司对本基金与公司旗下所有其他投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析,并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的样本,对其进行了95%置信区间,假设溢价率为0的T分布检验,检验结果表明,在T日、T+3日和T+5日不同循环期内,不管是买入或是卖出,公司各组合间买卖价差不显著,表明报告期内公司对旗下各基金进行了公平对待,不存在各投资组合之间进行利益输送的行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

第三季度,市场整体给人的感觉就是"弱"。

在股市降杠杆、经济增速放缓、改革不及预期等一系列因素共振下,股票市场在第三季度深度回调。三个月时间,上证综指跌去1200多点,跌幅28.63%,不但抹去了上半年涨幅,还使上证综指前三季度收跌5.62%。而经过第三季度30.34%的暴跌,深证成指前三季度收跌9.32%。

虽然市场赢弱,但并不缺少题材。国防军工、国企改革、互联网金融、计算机、中国制造2025等轮动频繁。资金面上,今年前三季度,央行分别进行了四次降息和降准,市场流动性较为宽裕,但人气涣散,指数方面并没有很好表现。

指数方面,经过6月中至7月初这一轮的暴跌,截止三季度末,上证综指和深证成指涨幅已全部抹除,还分别下跌5.62%和9.32%。而前期涨幅较好的创业板和中小板还分别存有41.51%和24.14%的涨幅。就中信证券一级行业指数而言,截止今年第三季度末,传媒、计算机、轻工制造涨幅都在50%以上,而券商、保险和银行以及传统的煤炭、有色、石油石化等涨幅最后。

作为指数基金,在操作上我们严格遵守基金合同,应用指数复制策略和数量化手段提高组合与指数的拟合度,降低跟踪误差。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金净值增长率为-25.06%,同期业绩比较基准收益率为-25.33%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济三季度运行较为疲弱,再加上国内股市波动影响,经济下行压力有所加大。在这个背景下,宏观调控政策加大了稳增长力度,基建项目加码、汽车购置税减免、首套房首付比例下调等举措相继出台,同时货币政策维持宽松。预计宏观经济在四季度有望出现改观,经济、金融运行的风险将得到缓解。

A股市场在三季度经历了大幅调整,对宏观经济的担忧、对汇率和资金问题的不确定均有所反映,杠杆比例高、股票估值贵的问题也得到缓解。考虑到四季度资金面依然宽松、宏观经济有望获得改观,预计四季度A股市场总体风险不大,结构性机会、主题性机会值得持续关注。

未来,本基金将继续严格按照基金合同的要求,秉承指数化投资策略,提高组合与指数的拟合度。

4.7报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§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	139,517,184.74	90.74
	其中:股票	139,517,184.74	90.74
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	13,873,327.30	9.02
7	其他资产	363,550.12	0.24
8	合计	153,754,062.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
C	制造业	368,380.00	0.24
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	368,380.00	0.24

5.2.2 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	-	-
B	采矿业	6,044,868.62	3.96
C	制造业	37,867,237.75	24.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,100,373.65	3.34
E	建筑业	7,100,053.95	4.65
F	批发和零售业	1,527,956.28	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,380,916.15	2.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,136,650.04	2.05
J	金融业	68,420,720.96	44.78
K	房地产业	5,847,385.76	3.83
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	723,641.58	0.47
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	139,148,804.74	91.07

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 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	600036	招商银行	439,480	7,809,559.60	5.11
2	601318	中国平安	259,146	7,738,099.56	5.06
3	600016	民生银行	800,173	6,761,461.85	4.43
4	600000	浦发银行	354,510	5,895,501.30	3.86
5	601166	兴业银行	383,810	5,588,273.60	3.66
6	000002	万 科A	321,863	4,097,315.99	2.68
7	601398	工商银行	691,910	2,989,051.20	1.96
8	600030	中信证券	201,106	2,731,019.48	1.79
9	601766	中国中车	207,346	2,689,277.62	1.76
10	601288	农业银行	871,763	2,641,441.89	1.73

5.3.2 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

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	002353	杰瑞股份	16,300	368,380.00	0.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

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

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

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

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的华夏银行(600015)于2015年5月5日公告称,公司收到《中共北京市纪委立案决定书》,中共北京市纪委对本公司副行长王耀庭先生的违纪问题予以立案。

对该股票的投资决策程序的说明:公司半年报中间业务收入受益于理财业务及银行卡业务快速增长而保持高速增长。升息收入受净息差环比下降影响增速放缓,考虑到利率市场化已接近尾声,这部分影响未来将减弱。公司未来看点是与微众签订战略合作协议,在多领域进行合作,推动较为薄弱的零售业务改善。估值较低,安全边际较高。经过本基金管理人内部严格的投资决策流程,该证券被纳入本基金的实际投资组合。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	334,514.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,631.75
5	应收申购款	26,404.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	363,550.12

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 报告期末股票投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票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	002353	杰瑞股份	368,380.00	0.24	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总