宝盈策略增长混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:宝盈基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	宝盈策略增长混合
基金主代码	213003
交易代码	213003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年1月19日
报告期末基金份额总额	3,588,309,465.98份
投资目标	基于中国经济处于宏观变革期以及对资本市场未来持续、健康增长的预期,本基金力求通过综合运用多种投资策略优选股票,分享中国经济和资本市场高速增长的成果,在严格控制投资风险的前提下保持基金资产持续稳健增值,并力争获取超过比较基准的收益。
投资策略	1. 资产配置策略 本基金根据宏观经济运行状况、财政货币政策、国家产业政策及证券监管政策调整情况、市场资金环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。 2. 股票投资策略 本基金股票投资策略主要通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的股票构建投资组合。主题投资策略、价值成长策略和价值反转策略互相配合以构成本基金的整体投资策略。三种投资策略的投资权重大致平均分配,在考虑行业大致均衡配置的前提下,重叠的个股加大权重。本基金管理人将根据国际经济、国内经济、经济政策、股市结构、股市政策等方面因素的综合考虑,根据研究部提供并经投资决策委员会批准的投资策略对各投资策略的投资权重进行微调。 3. 债券投资策略 本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。
业绩比较基准	上证A股指数×75%+上证国债指数×20%+同期银行一年定期存款利率×5% 当作为本基金业绩比较基准的指数因中断编制等原因或市场出现更合适的新指数时,本基金业绩比较基准将做适时调整。
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低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	宝盈基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	129,051,710.88
2.本期利润	2,077,537,802.90
3.加权平均基金份额本期利润	0.5478
4.期末基金资产净值	6,601,383,499.21
5.期末基金份额净值	1.8397

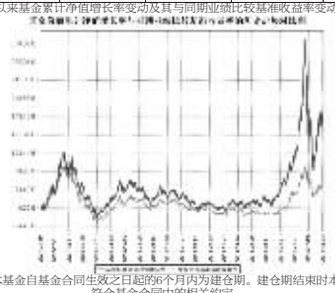
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。
2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	41.81%	2.37%	12.28%	1.18%	29.53%	1.19%

3.2.2 目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



注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§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		
彭敢	本基金、宝盈资源优选混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、宝盈科技30灵活配置混合型证券投资基金、宝盈鑫安中创新灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;总经理助理;投资部总监	2014年9月26日	-	14年	彭敢先生,金融学硕士。曾就职于大鹏证券有限责任公司综合研究所、银华基金管理有限公司投资管理部、万联证券有限责任公司研发中心、财富证券有限责任公司从事投资研究工作。2010年9月起任职于宝盈基金管理有限公司投资部。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

4.2 管理人对投资纪律的说明

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》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定,以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内,基金运作合法合规,严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控,并定期制作公平交易分析报告,对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明,本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内;在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在投资活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,无损害基金持有人利益的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第四季度A股市场表现较为稳健的反弹走势,上证指数、沪深300、深成指和创业板均出现稳步上扬,分别上涨15.93%、16.49%、27.35%和28.12%,本季度指数走势让市场重新恢复活力,成交量也逐渐企稳。本基金在四季度实现收益41.81%,为持有人获得较好的投资收益。

本基金管理人认为,本届政府对中国经济转型的决心毋庸置疑,虽然从宏体经济的增速来看,中国经济仍然在持续的下滑调整过程中,政府需要通过各种货币政策工具操作来降低实体经济利率,同时也通过供给侧改革来加速传统产业整合升级;从整体来看,政府依然能有决心实现稳步的经济增长,同时也全面支持发展新兴产业,无论是对创业者的政策环境支持还是通过资本市场改革来扶持新兴企业发展,都能体现国家对经济结构转型升级的决心。在前四季度,本基金管理人一直以代表经济增长转型的战略性新兴产业个股作为重点投资标的,虽然结果来看投资收益不能算顶级,但基本能按照本基金管理人的投资理念来执行,虽然经历了三季度市场系统性下跌,管理人也未能幸免于下跌,但在较低位置主动参与了反弹,并取得了不错的效果。

2015年四季度A股经历了三季度剧烈震荡后逐渐企稳,政府通过大量救市资金入市和上市公司限制减持等措施让市场取得了阶段性稳定市场效果;从资金面来分析,从改革转型叠加杠杆资金市场导致过快上涨的市场出现了大幅调整,较多的杠杆资金在三季度加速撤离市场,但是在四季度出现了稳定,基本表现为存量资金在市场博弈态势;从公司基本面来分析,三季度大多数上市公司并未出现季报业绩低于预期的情况,甚至不少新兴成长公司三季报业绩大幅超预期,也成为市场新的龙头;从过往历史来看,基金管理人一直坚持以较严格的公司成长模式和业绩增长标准来操作,在板块选择上坚持选择与过往市场不同的新的投资方向和新成长主题,虽然由此也丧失了一些投资机会,也未能将提前布局的优质成长股收益最大化等,但从整体结果来看,较为理想。季度末主要持仓集中在医药、军工、新能源、TMT、农业、环保等方向。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金在本报告期内净值增长率是 41.81%,同期业绩比较基准收益率是 12.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	6,104,260,255.06	91.63
	其中:股票	6,104,260,255.06	91.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	159,166,915.10	2.39
	其中:债券	159,166,915.10	2.39
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	330,345,054.73	4.96
8	其他资产	67,873,468.71	1.02
9	合计	6,661,645,693.60	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	314,739,156.79	4.77
B	采矿业	72,492,154.21	1.10
C	制造业	3,772,602,285.93	57.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,388,093.75	0.31
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	1,509,595,641.80	22.87
J	金融业	101,510,751.64	1.54
K	房地产业	55,815,572.48	0.85
L	租赁和商务服务业	91,845,592.36	1.39
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	109,963,155.80	1.67
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	55,307,850.30	0.84
S	综合	-	-
	合计	6,104,260,255.06	92.47

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	002368	太极股份	9,500,492	637,483,013.20	9.66
2	002522	浙江众成	22,355,747	414,251,991.91	6.28
3	300252	金信诺	9,001,031	363,641,652.40	5.51
4	603456	九洲药业	4,101,935	285,932,477.85	4.33
5	300170	汉得信息	13,900,000	275,915,000.00	4.18
6	002023	海特高新	12,542,000	230,020,280.00	3.48
7	002773	康弘药业	2,277,606	187,219,213.20	2.84
8	002215	诺普信	9,384,163	179,988,246.34	2.73
9	300094	国联水产	6,701,181	168,869,761.20	2.56
10	002373	千方科技	3,512,019	160,674,869.25	2.43

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	159,166,915.10	2.41
	其中:政策性金融债	159,166,915.10	2.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	159,166,915.10	2.41

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	1,591,510	159,166,915.10	2.41

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
本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂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
本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等,本基金暂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
本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
报告期内本基金投资的前十名证券发行主体中没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内除九洲药业(代码:603456)、国联水产(代码:300094)外未受到公开谴责、处罚。

2015年1月17日,浙江九洲药业股份有限公司(以下简称"公司")位于浙江省化学原料药基地的临海分公司五车间三合一设备发生爆燃事故,造成1名工人受伤,经抢救无效死亡。事故发生后,公司立即启动突发事件应急处置预案,并按规定向有关部门报告。此次事故涉及的资产均在财产保险公司承保范围内,未对公司生产经营造成重大影响,也未对公司的经营业绩产生较大影响。2015年4月22日,公司公告收到临海市安全生产监督管理局出具的行政处罚决定书,认定该事故为一般生产安全责任事故,给予公司处以罚款二十二万元的行政处罚。公司预计该事故不会对公司的生产经营和业绩产生较大影响。我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在事故发生后及处罚决定下达后未做减持。

2015年12月21日,深交所发布《关于对湛江国联水产开发股份有限公司及相关当事人给予通报批评的决定》。湛江国联水产开发股份有限公司(以下简称"国联水产")及相关当事人存在以下违规行为:国联水产披露的2014年度业绩快报的财务数据与2014年年报披露的财务数据相比,净利润相差较大,且业绩快报修正公告的披露时间严重滞后。国联水产董事长李忠、董事兼总经理陈汉、董事兼副总经理、时任财务总监吴丽青未能恪尽职守、履行诚信勤勉义务,上述行为均违反了《创业板股票上市规则(2014年修订)》相关规定,相关当事人对上市公司的违规行为负有重要责任。鉴于上述违规事实和情节,深交所对上市公司及相关当事人做出通报批评的处分,并记入上市公司诚信档案,向社会公布。此次事件短期内对上市公司的上一年度经营业绩产生了影响,但对当季不产生影响,并且从长期看,不影响公司的启续发展和战略规划。我们关注到此事是公司管理细节上的问题,确实需要改进,但并不影响我们继续看好公司的长期投资价值,因此在通报批评决定下达后未做减持。

5.11.2
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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,344,218.96
2	应收证券清算款	39,999,983.76
3	应收股利	-
4	应收利息	9,262,199.53
5	应收申购款	13,267,066.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,873,468.71

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	603456	九洲药业	28,127,795.00	0.43	非公开发行

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	3,854,572,446.73
报告期期间基金总申购份额	563,731,556.77
减:报告期期间基金总赎回份额	829,994,537.52
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,588,309,465.98

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内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

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准宝盈策略增长股票型证券投资基金设立的文件。
根据《关于宝盈策略增长股票型证券投资基金更名并相应修改基金合同的公告》将宝盈策略增长股票型证券投资基金名称变更为宝盈策略增长混合型证券投资基金。
《宝盈策略增长混合型证券投资基金基金合同》。
《宝盈策略增长混合型证券投资基金基金托管协议》。
宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

9.2 存放地点
基金管理人办公地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦10层
基金托管人办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9

9.3 查阅方式
上述备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司
2016年1月20日

华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华润元大医疗保健量化混合
交易代码	000646
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月18日
报告期末基金份额总额	38,838,395.60份
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票,通过量化与基本面相结合的方法,精选优质上市公司,在控制风险、确保基金资产流动性的前提下,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩比较基准的长期收益。
投资策略	1.大类资产配置策略 宏观经济、政策法规以及证券市场表现为资产配置策略的主要考量因素。 2.股票投资策略 股票投资策略是本基金的核心部分,本基金将结合定量与定性分析,充分发挥基金管理人研究团队和投资团队的选股能力,选择具有长期持续增长能力的公司。 3.债券投资策略 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。 4.股指期货投资策略 本基金将以股指期货为主要的金融衍生工具,与资产配置策略进行搭配。 5.权证投资策略 本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可投权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。 6.资产支持证券投资策略 本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。 7.现金管理 在现金管理上,本基金通过对未来现金流的预测进行现金预算管理,及时满足本基金运作中的流动性需求。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。
基金管理人	华润元大基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	3,007,895.90
2.本期利润	14,494,351.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.3723
4.期末基金资产净值	59,653,587.25
5.期末基金份额净值	1.536

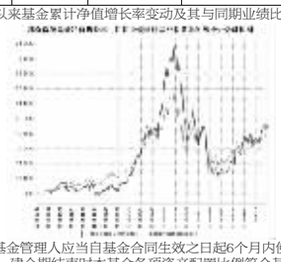
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	32.41%	2.07%	16.91%	1.52%	15.50%	0.55%

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



注:按基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。 建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

§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		
袁华涛	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理	2015年9月16日	-	6年	曾任华泰证券股份有限公司研究员,华泰证券(上海)资产管理有限公司量化投资经理。2015年9月16日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2015年9月16日起担任华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理。中国,西南财经大学金融学博士,具有基金从业资格。

注:1.基金经理任职日期和离任日期为公司作出决定后正式对外公告之日;担任新成立基金的基金经理,即基金的首任基金经理,其任职日期为基金合同生效日。
2.证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中的相关规定。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定,在投资管理活动中公平对待不同投资组合,公平交易制度执行情况良好,未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在异常交易行为。

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

2015年第四季度股票市场经过第三季度的大幅调整后迎来了反弹,以创业板为代表的小盘成长板块反弹幅度较大。创业板指数上涨30.32%,中小板指数上涨23.81%,上证综指上涨15.93%,沪深300指数上涨16.49%,上证50指数上涨12.80%,富时中国A50指数上涨14.82%。中信一级29个行业中综合(62.89%)、计算机(54.99%)、房地产(45.84%)板块较强,涨幅前三;而钢铁(6.54%)、银行(11.52%)、交通运输(12.02%)板块走势明显较弱,涨幅居后。

本基金作为被动指数型基金,报告期内,本基金采用完全复制法紧密跟踪中创100指数,取得与业绩比较基准基本一致的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为2.375元,本报告期份额净值增长率为24.93%,同期业绩比较基准收益率为23.94%;报告期内,本基金的日均跟踪偏离度为0.05%,在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年宏观经济依然面临较大的下行压力,为实现全年经济增长目标政策有望更加积极。一方面,货币政策将继续保持宽松,除常规降准降息之外,将继续通过地方政府债务置换、专项金融债以及城投债加速发行等推动社会融资总量扩张;另一方面,财政政策将有效发力,财政赤字率将突破3%。中央经济工作会已经确定"去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板"五大任务,供给侧改革将会逐步落地。下一步值得警惕的时间窗口期是3-4月,美联储加息、去产能去杠杆、注册制等各类不利影响集中出现。

2016年,机遇与风险并存的股票市场有望在曲折中震荡前行。资金面总体较为宽松有望推动无风险利率继续下行,这将有助于推动大类资产配置转向权益类市场,创新驱动有望推动中国经济加速转型,这些有利因素有望将对市场形成支撑;同时,实体经济仍面临较大的下行压力,在刚性兑付逐步打破的情况下信用风险存在蔓延可能,注册制推出可能加大市场供给压力,这些不利因素可能对市场形成压力。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	53,740,406.74	87.55
	其中:股票	53,740,406.74	87.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,000,000.00	1.63
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,187,633.24	10.08
8	其他资产	453,284.72	0.74
9	合计	61,381,324.70	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	-	-
C	制造业	49,470,599.74	82.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	458,561.00	0.77
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,846,010.00	4.77
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	965,236.00	1.62
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,740,406.74	90.09

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	002626	金达威	82,843	1,607,982.63	2.70
2	002019	亿帆鑫富	37,400	1,496,000.00	2.51
3	002287	奇正藏药	34,300	1,426,194.00	2.39
4	000989	九芝堂	42,900	1,382,238.00	2.32
5	002399	海普瑞	37,514	1,326,870.18	2.22
6	600436	片仔癀	19,074	1,312,100.46	2.20
7	300146	汤臣倍健	33,300	1,282,050.00	2.15
8	600252	中恒集团	171,100	1,255,874.00	2.11
9	300009	安科生物	28,609	1,238,197.52	2.08
10	300199	翰宇药业	50,100	1,233,963.00	2.07

5.4 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。

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
注: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
注: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
注: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
注: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
注:本基金本报告期末未投股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末持仓股指期货。

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
本基金本报告期末持仓国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末持仓国债期货。

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中没有出现发行主体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、处罚的情形。

5.11.2
本报告期内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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	122,897.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,209.50
5	应收申购款	329,177.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	453,284.72

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	37,829,267.79
报告期期间基金总申购份额	10,526,151.31
减:报告期期间基金总赎回份额	9,517,023.50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	38,838,395.60

注:本基金总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§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
注:本报告期期初基金管理人未持有本基金份额,且报告期内基金管理人持有基金份额未发生变动。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会关于核准本基金募集的批复;
2、本基金基金合同;
3、本基金托管协议;
4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点
以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

8.3 查阅方式
基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
2016年1月20日

华润元大中创100交易型开放式指数证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:华润元大基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2016年1月20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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华润元大中创100ETF
场内简称	中创100
交易代码	159942
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015年5月25日
报告期末基金份额总额	51,993,705.00份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准表现相当,以便为投资者带来长期收益。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成分股组成及其权重构建投资组合,并根据标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成分股发生调整和成