金元顺安丰祥债券型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
(原"金元惠理基金管理有限公司")
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15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	金元顺安丰祥债券基金
基金主代码	620009
交易代码	620009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月14日
报告期末基金份额总额	20,984,886.20份
投资目标	本基金采用投资组合保险技术,在严格控制风险和保证本金安全的基础上,力争在保本周期内达到目标收益,实现基金资产的稳健增值。
投资策略	在大类资产配置方面,本基金按照优化的恒定比例投资组合保险策略(以下简称CPPI策略),通过对风险资产和保本资产的动态配置管理,确保投资者的本金的安全性;同时,本基金通过积极稳健的债券资产和股票资产投资策略,努力为基金资产获取更高的增值回报。 在债券投资方面,通过投资于剩余期限与避险周期基本匹配的债券,规避利率等各种风险,控制企业债信用风险以及流动性风险,并注重利用市场时机、无风险套利、利率预测以及低估值等策略,力争获取稳健的债券投资收益。在股票投资方面,本基金采用自上而下与自下而上相结合的投资策略,首先进行行业投资价值评估,重视行业中长期的发展前景;其次精心筛选个股,强调对上市公司基本面的深入研究,精心挑选优势行业中的优势企业。
业绩比较基准	中债综合指数。
风险收益特征	本基金是一只债券型基金,属于基金中的较低预期风险较低预期收益的品种,其预期风险收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金及混合型基金。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司(原"金元惠理基金管理有限公司")
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	1,086,960.22
2.本期利润	537,375.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0246
4.期末基金资产净值	25,538,305.36
5.期末基金份额净值	1.217

注:(1)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;

(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	2.10%	0.15%	1.81%	0.08%	0.29%	0.07%

注:(1)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;

(2)本基金业绩比较基准为:中债综合指数;

(3)本基金从2015年1月14日起正式转型为债券型证券投资基金。

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

金元顺安丰祥债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年1月14日至2015年12月31日)

注:(1)本基金合同生效日为2013年2月5日;

(2)本基金建仓期为2013年2月5日至2013年8月4日,在建仓期末和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定;

(3)本基金从2015年1月14日起正式转型为债券型证券投资基金;

(4)本基金转型后业绩比较基准为:中债综合指数;

(5)本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的 80%。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购或增发新股,持有的因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证和因投资分离交易可转债所形成的权证应在其可交易之日起的30 个交易日内卖出。

§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		
李杰	本基金基金经理	2015-1-14	-	8	金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安保本混合型证券投资基金和金元顺安金元宝货币市场基金基金经理,上海交通大学理学硕士。曾任国联安基金证券管理有限公司数量策略分析员、固定收益高级研究员。2012年4月加入金元顺安基金管理有限公司。8年证券、基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、基金合同和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等,重视交易执行环节的公平交易措施,启用投资交易系统中的公平交易模块,以确保公平对待各投资组合。在报告期内,本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,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

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《异常交易监控与报告制度》。本报告期,根据制度的规定,对交易进行了监控,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度,我国经济下行趋势仍未结束。固定资产投资同比增速下降到10.2%,其中房地产投资和制造业投资下滑幅度较大,增速分别下滑到1.3%和8.4%;而基础设施建设投资增速处在18%高位。社会消费品零售总额平稳增长,增速保持在10.6%左右水平,说明消费需求能力较强。国际经济形势依然复杂,拖累出口增速在-7%左右,对经济增长贡献有限。工业增加值累计同比下降到6.1%水平,PMI指数连续保持在荣枯分界线50以下,显示经济增长动能较弱。CPI维持在1.6%较低水平,PPI则保持在-5.9%,二者呈现较大背离。

央行继续采取稳健货币政策,致力于降低市场利率水平和化解金融体系风险。一方面通过降息降准,配合公开市场操作和利率走廊机制,降低货币市场资金利率,稳定资金面预期;同时进一步增强汇率市场化形成机制,引导人民币实际有效汇率向合理水平回归。另一方面,成功推动人民币加入SDR货币篮子,促进人民币国际化。同时,决策层着力推进供给侧改革,增强政策的有效性,促进经济结构转型。在一系列政策配合下,货币金融条件维持宽松,市场利率继续下降,避险情绪稳定,股市债市同时上涨。

上证综指单季度上涨15.93%,中证转债指数上涨5.24%,中债综合指数上涨1.81%。

在报告期,本基金积极配置资质较高的债券,并适当增加了久期,以追求债券上涨的资本利得收益。

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2.09%,同期业绩比较基准增长率为1.8%。本基金超越基准0.29%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为债券市场进入牛市下半场,但是随着市场利率接近历史新低,2016年预期收益将下降,波动水平增加,低评级信用债的风险加大。我们将重点配置中高评级的债券,控制信用风险。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在本报告期内,该基金曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形:

截止到2015年12月31日,该基金连续一百七十五个工作日出现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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	21,263,998.60	74.31
	其中:债券	21,263,998.60	74.31
	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	3,000,000.00	10.48
	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	4,045,047.08	14.14
7	其他资产	306,890.88	1.07
8	合计	28,615,936.56	100.00

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。

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。

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	14,013,903.60	54.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	6,253,960.00	24.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	996,135.00	3.90
9	合计	21,263,998.60	83.26

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	019518	15国债18	75,000	7,494,750.00	29.35
2	019317	13国债17	50,000	5,042,500.00	19.74
3	122393	15恒大03	20,000	2,200,000.00	8.61
4	122392	15恒大02	20,000	2,062,000.00	8.07
5	122383	15恒大01	19,000	1,991,960.00	7.80

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。

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 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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、处罚的情形。

5.11.2 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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,846.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	301,014.68
5	应收申购款	29.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	306,890.88

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	22,906,474.80
报告期期间基金总申购份额	24,754.69
减:报告期期间基金总赎回份额	1,946,343.29
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	20,984,886.20

§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

本报告期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期间内基金管理人未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

1、2015年10月8日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元顺安基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金申购金额下限的公告;

2、2015年10月27日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元顺安丰祥债券型证券投资基金2015年第3季度报告;

3、2015年12月31日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元顺安基金管理有限公司关于实施指数熔断调整旗下基金开放时间的公告;

4、2015年12月31日,在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和www.jyvpfund.com上公布金元顺安丰祥债券型证券投资基金(原金元惠理丰祥债券型证券投资基金)年度最后一个市场交易日(或自然日)净值公告。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《金元顺安丰祥债券型证券投资基金基金合同》;

2、《金元顺安丰祥债券型证券投资基金基金招募说明书》;

3、《金元顺安丰祥债券型证券投资基金托管协议》。

9.2 存放地点

上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦36层3608室

9.3 查阅方式

http://www.jyvpfund.com

金元顺安基金管理有限公司(原"金元惠理基金管理有限公司")
二〇一六年一月二十一日

金元顺安核心动力混合型证券投资基金

【2015】第四季度报告

基金管理人:金元顺安基金管理有限公司
(原"金元惠理基金管理有限公司")
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月18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	金元顺安核心动力混合
基金主代码	620006
交易代码	620006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年2月11日
报告期末基金份额总额	29,686,267.36份
投资目标	通过运用"核心-卫星"股票投资策略,将大部分基金资产用于完全复制大型上市公司股票指数(中证100指数)的业绩表现,并将部分资产投资于中证100指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票,在控制组合风险的前提下,追求基金资产中长期的稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略分为两个层次:第一层为大类资产配置策略,以确定基金资产在股票、债券和现金之间的比例;第二层以"核心-卫星"策略作为基金股票资产的配置策略。 本基金的股票投资组合由"核心组合"和"卫星组合"两部分构成:核心组合采取被动投资方法,原则上对反映大市值股票走势的基准指数——中证100指数——采用完全复制法,按照成分股在该指数中的基准权重构建指数化投资组合。核心组合的市值介于股票资产的60%-100%。卫星组合采取自下而上的方法精选中证100指数以外的具备良好成长潜力且价值被低估的上市公司股票,以期获得成长企业的估值溢价。卫星组合的市值介于股票资产的0%-40%。 本基金的债券投资组合以具票息优势的债券作为主要投资对象,并通过对债券的信用、久期和凸性等的灵活配置,进行相对积极主动的操作,力争获取超越债券基准的收益。
业绩比较基准	中证100指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金与货币市场基金,属于较高风险、较高收益的证券投资基金品种。
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司(原"金元惠理基金管理有限公司")
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10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	377,669.61
2.本期利润	3,889,346.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.1292
4.期末基金资产净值	35,203,806.54
5.期末基金份额净值	1.186

注:(1)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;

(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	12.10%	1.43%	11.93%	1.27%	0.17%	0.16%

注:(1)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;

(2)本基金选择中证100指数作为股票投资部分的业绩基准,选择中债总指数作为债券投资部分的业绩基准,复合业绩比较基准为:

中证100指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%;

(3)本基金合同生效日为2010年2月11日。

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

金元顺安核心动力混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年2月11日至2015年12月31日)

注:(1)本基金合同生效日为2010年2月11日;

(2)基金合同约定的投资比例为股票资产占基金资产的60%-95%,债券资产、现金资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%;本基金的建仓期系自2010年2月11日起至2010年8月10日止,在建仓期末和本报告期末各项资产市值占基金净值的比率均符合基金合同约定。

§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		
侯斌	本基金经理	2015-7-4	-	13	金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安核心动力混合型证券投资基金和金元顺安价值增长混合型证券投资基金基金经理,上海财经大学经济学学士。曾任光大保德信基金管理有限公司行业研究员。2010年6月加入本公司,历任高级行业研究员,金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理和金元顺安核心动力股票型证券投资基金基金经理助理等职位。13年基金等金融行业从业经历,具有基金从业资格。

注:1.此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日,若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日;

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金销售管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则、基金合同和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作整体合法合规,无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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,本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,通过科学完善的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、股票备选库管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等,重视交易执行环节的公平交易措施,启用投资交易系统中的公平交易模块,以确保公平对待各投资组合。在报告期内,本管理人对不同投资组合的交易价差、收益率进行分析,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

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,制定了《异常交易监控与报告制度》。本报告期,根据制度的规定,对交易进行了监控,未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金重点投资于医药、食品饮料、教育、军工等板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

报告期内,本基金份额净值增长率为18.48%,业绩比较基准收益率为13.77%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年中国经济,我们判断2016年的经济环境会更加复杂,国内面临供给过剩、需求不足,旧经济模式较过去更为困顿,中国经济转型仍在进行中,新旧经济之间的转换由于体量上的不匹配,使得整体经济仍然处于重心下移阶段。中长期来看,中国经济必然也必须转型成功,但短期阵痛无法避免,而在2016年将尤为突出。从国外经济来看,美国进入加息周期,这对全球新兴市场都将产生深远影响,全球货币可能回流美国,但从整体全球经济来看,整体需求不足,经济下滑,也对中国外需带来负面影响。再看国内流动性的因素,国内货币继续大幅宽松的空间不大,而美元升值,资金流出,将加剧国内流动性紧张,年内应该有一次以上降准,但我们判断流动性较2015年紧张。

重点优选超跌个股、业绩超预期和消费类稳定增长类公司进行投资。

4.7 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

在本报告期内,该基金曾出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元情形:

截止到2015年12月31日,该基金连续一百三十二个工作日出现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	23,278,625.72	65.79
	其中:股票	23,278,625.72	65.79
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	11,326,473.12	32.01
7	其他资产	778,881.51	2.20
8	合计	35,383,980.35	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	836,176.85	2.38
C	制造业	7,050,148.88	20.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	712,088.72	2.02
E	建筑业	1,065,026.20	3.03
F	批发和零售业	219,880.60	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	431,976.32	1.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	542,382.98	1.54
J	金融业	11,097,767.11	31.52
K	房地产业	1,204,204.16	3.42
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	118,984.80	0.34
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	23,278,625.72	66.13

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	601318	中国平安	39,684	1,428,624.00	4.06
2	600036	招商银行	60,997	1,097,336.03	3.12
3	600016	民生银行	108,782	1,048,658.48	2.98
4	000002	万 科A	34,512	827,597.76	2.35
5	300007	汉威电子	22,600	772,920.00	2.20
6	600000	浦发银行	40,807	745,543.89	2.12
7	601166	兴业银行	42,221	720,712.47	2.05
8	600030	中信证券	28,498	551,436.30	1.57
9	601988	中国银行	137,195	550,151.95	1.56
10	601328	交通银行	72,460	466,642.40	1.33

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期有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、处罚的情形。

1、关于汉威电子(代码:300007)的处罚说明

公司日前收到孙公司合肥嘉园水处理投资有限公司董事高某某、陈某某的书面告知函,两人因合肥嘉园水处理投资有限公司在承接项目过程中涉嫌单位行贿,被安徽省有关检察机关立案侦查并取保候审,案件正在侦查过程中。

现作出说明如下:

A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念,看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。我们判断此次事件对公司盈利能力的影响,此事件是在公司买入后发生,我们认为不会对整体的业绩造成影响,因此继续持有公司股票。

2、关于湖北金环(代码:000615)的处罚说明

2015年6月26日,湖北省环保局有限公司(以下简称"公司")收到中国证券监督管理委员会湖北监管局(以下简称"湖北证监局")对公司下达的行政监管措施决定书及炒送转公司关于对相关人员行政监管措施的决定书,分别为《湖北证监局关于对湖北金环采取责令改正措施的决定》([2015]9号)、《湖北证监局关于对李红采取出具警示函措施的决定》([2015]7号)及《湖北证监局关于对雷生安采取出具警示函措施的决定》([2015]8号)。

中国证券监督管理委员会湖北监管局发现湖北化纤开发有限公司在2013年10月30日至2015年5月22日期间,通过深圳证券交易所证券交易系统以大宗交易方式和集中竞价交易方式累计减持湖北金环股份有限公司(以下简称"湖北金环")股份11,264,325股,占"湖北金环"总股本的5.32%.在卖出"湖北金环"股份达到5%时,未能及时向中国证监会和交易所提交书面报告并披露权益变动报告书,在履行报告和披露义务前没有停止卖出"湖北金环"股份。上述行为违反了《证券法》第八十六条、《上市公司收购管理办法》第十三条、《上市公司信息披露管理办法》第四十六条的有关规定。

2015年7月25日,湖北金环股份有限公司(以下简称"公司")第二大股东湖北化纤开发有限公司(以下简称"化纤开发")收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《调查通知书》(哪证调查通字011号):因化纤开发涉嫌违规减持"湖北金环"股份,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,中国证监会决定对化纤开发立案调查。

2015年 11月 4日,公司收到股东湖北化纤开发有限公司(以下简称"湖北化纤")转来的中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》【(2015)42号】,经查明,湖北化纤存在以下违法事实:湖北化纤作为湖北金环股份有限公司(以下简称"湖北金环")的第二大股东,于 2013年10月至2014年12月31日期间,通过深圳证券交易所证券交易系统以大宗交易方式和集中竞价交易方式累计减持湖北金环股份9,260,000股,占"湖北金环"总股本的4.37%。2015年5月21日,湖北化纤通过集中竞价交易方式减持"湖北金环"1,353,452股后,累计减持"湖北金环"股份数量达10,613,452股,占湖北金环总股本的5.01%。其中当日超比例减持数量为29,586股,占总股本的0.014%,成交均价为20.05元,交易金额为593,199.30元。2015年5月22日,湖北化纤通过集中竞价交易方式继续减持"湖北金环"650,873股,累计减持占"湖北金环"总股本的5.32%。当日超比例减持数量为650,873股,占总股本的0.3075%,交易金额为13,047,650.15元。综上,湖北化纤减持湖北金环已发行股份累计达到5%时,没有在履行报告和披露义务前停止卖出"湖北金环",违反法律规定减持累计达680,450股,成交金额为13,640,849.45元。湖北化纤的董事会秘书刘新闻作为本次减持操作的全权负责人,是涉案违法行为的直接负责的主管人员。

2015.11.24深交所对湖北金环股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定经查明,湖北金环股份有限公司(以下简称"湖北金环")及相关当事人存在以下违规事实:湖北金环于 2012-2014 年期间存在对第二大股东湖北化纤开发有限公司提供关联财务资助的行为,其中,2012 年度最高资助余额为 12389.69 万元,2013 年度最高资助余额为 13242.39 万元,2014年度最高资助余额为15035.68 万元,分别占湖北金环上一年度经审计净资产的 21.04%,20.79%,23.60%,但上述财务资助均未履行相应审议程序,且湖北金环历年来的公开信息中均将上述非经营性资金占用披露为经营性资金占用。湖北金环上述行为违反了深交所《股票上市规则(2012 年修订)》第 2.1 条、第 10.2.5 条以及《股票上市规则(2014 年修订)》第2.1 条、第 10.2.5 条规定。湖北金环董事兼任总经理盛永新,董事郑均、郑春苗、郭叔明,时任董事朱俊峰、蒋斌、赵宏启、陈鸿寿、史庆进、杜胥兴、杨涂,监事刘继峰、任文明,总见证,时任监事张静、刘磊,时任财务总监雷生安未维持尽职守,履行诚信勤勉义务,违反了深交所《股票上市规则(2012 年修订)》第 2.2 条、第 3.1.5 条以及《股票上市规则(2014 年修订)》第 2.2条、第 3.1.5 条的规定,对湖北金环上述违规行为负有重要责任。

现作出说明如下:

A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念,看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件主要是个别股东减持披露违规,对公司影响有限,公司经营活动一切正常,因此继续持有该公司。

3.关于大津磁卡(代码:600800)的处罚说明

公司于2015年1月22日收到天津证监局对公司采取责令改正措施的决定(津证监措施字【2015】1号),具体内容如下:

经查,我局发现你公司2013年度、2014年度与控股股东天津环球磁卡集团有限公司发生大额关联资金往来,相关支付金额分别达到39,360万元和5,077万元,分别占公司上一年度经审计净资产的420.12%和83.68%。上述关联交易均达到需提交股东大会审议并披露的标准,但你公司未按规定审议并披露上述关联交易,也未在相应年度的定期报告中披露相关关联交易发生额。

上述行为违反了《上市公司信息披露管理办法》第二条、第四十八条的有关规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条的规定,现要求你公司采取切实有效的措施进行改正:一是立即补充披露2013年度、2014年度与上述关联人的关联交易详细情况及原因,同时立即更正2013年度、2014年度披露的定期报告相关财务信息;二是严格加强关联关系识别及关联交易管理,严格规范公司与控股股东及其他关联方的资金往来,认真履行关联交易的信息披露义务;三是公司董事、监事、高级管理人员应加强对有关法律法规的学习,并采取切实有效的措施提升公司信息披露水平和内控管理水平;四是根据公司规定开展内部问责,督促有关人员勤勉尽责。

现作出说明如下:

A.投资决策程序:基金经理根据投资决策委员会和投资总监制定的投资策略和资产配置方案,综合考虑大类资产配置和行业配置比例对不同行业进行投资金额分配,同时在研究部的支持下,对准备重点投资的公司进行深入的基本面分析,最终构建投资组合。

B.基金经理遵循价值投资理念,看重的是上市公司的基本面和长期盈利能力。此次事件主要是个别股东减持披露违规,对公司影响有限,公司经营活动一切正常