

**上接B037版**  
 公司简称: 中经北证  
 注册地址: 北京市西城区车公庄大街4号6号楼1层  
 办公地址: 北京市西城区车公庄大街4号6号楼1层  
 法定代表人: 徐福银  
 联系人: 陈雪莹  
 联系电话: 13261320700  
 业务传真: 010-88315560  
 客服热线: 010-68968820  
 公司网址: www.bzfunds.com  
 (78) 名称: 一路财富(北京)信息科技有限公司  
 公司简称: 一路财富  
 注册地址: 北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702  
 办公地址: 北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层  
 法定代表人: 吴雪秀  
 联系人: 刘栋栋  
 联系电话: 010-88312877-8009  
 业务传真: 010-88312099  
 客服热线: 400-001-1566  
 公司网址: www.yilucaifu.com  
 (79) 名称: 北京嘉瑞耀华投资咨询有限公司  
 注册地址: 北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室  
 办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A303  
 法定代表人: 王岩  
 联系人: 胡明会  
 联系电话: 010-59200855  
 业务传真: 010-59200800  
 客服热线: 400-819-9868  
 公司网址: www.tdyhfund.com  
 (80) 名称: 中经北证投资有限公司  
 注册地址: 重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B, 名义层11-A、8-B4、9-B-C  
 办公地址: 重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼  
 法定代表人: 彭文德  
 联系人: 刘芸  
 联系电话: 023-86769637  
 业务传真: 023-86769629  
 客服热线: 400-8877-780  
 公司网址: www.cdc108.com.cn  
 (81) 名称: 海银基金销售有限公司  
 注册地址: 上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元  
 办公地址: 上海市浦东新区东方路1217号16楼  
 法定代表人: 刘惠  
 联系人: 刘艳妮  
 联系电话: 021-80133827  
 业务传真: 021-80133413  
 客服热线: 400-808-1016  
 公司网址: www.fundhaiyin.com  
 (82) 名称: 北京恒久信信投资咨询有限公司  
 注册地址: 北京市怀柔区怀北镇怀北路308号  
 办公地址: 北京市朝阳区光华路7号汉城大厦16B5(西区15层)  
 法定代表人: 谢亚凡  
 联系人: 陈冲  
 联系电话: 010-88580321  
 业务传真: 010-88580366  
 客服热线: 4006-525-676  
 公司网址: www.haofunds.com  
 (83) 名称: 山西证券股份有限公司  
 住所: 山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  
 法定代表人: 侯魏  
 联系人: 郭耀  
 电话: 0351-8896959  
 传真: 0351-8896919  
 客服电话: 400-666-1618、95573  
 公司网址: www.sj618.com.cn  
 (84) 名称: 威海市商业银行股份有限公司  
 注册地址: 威海市环翠区宝泉路9号  
 办公地址: 威海市环翠区宝泉路9号  
 法定代表人: 谢光恩  
 联系电话: 0631-5222293  
 业务传真: 0631-5215726  
 客服热线: 省内96636, 境内40000-96636  
 公司网址: www.whccb.com.cn  
 (85) 名称: 上海农商银行股份有限公司  
 注册地址: 上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼  
 办公地址: 上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼  
 法定代表人: 胡晋文  
 联系人: 施传荣  
 联系电话: 021-38576666  
 业务传真: 021-50105124  
 客服热线: 962909  
 公司网址: www.shrcb.com  
 (86) 名称: 中信证券股份有限公司  
 注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)1北座  
 办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦  
 法定代表人: 王东明  
 联系人: 陈忠  
 电话: 010-60833722  
 传真: 010-60833739  
 客服电话: 95548  
 公司网址: www.cs.ecitic.com  
 (87) 名称: 中信证券(山东)有限责任公司  
 注册地址: 山东省青岛市崂山深圳路222号1号楼2001  
 办公地址: 青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融中心广场20层(266061)  
 法定代表人: 张智河  
 联系人: 吴志超  
 电话: 0632-85022326  
 传真: 0632-85022605  
 客服热线: 95548  
 公司网址: www.czw.com.cn  
 (88) 名称: 中信证券(浙江)有限责任公司  
 注册地址: 浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层  
 办公地址: 浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层  
 法定代表人: 沈强  
 联系人: 王瑞雷  
 电话: 0571-89078823  
 客服电话: 95548  
 公司网站: www.bigsun.com.cn  
 (89) 名称: 德邦证券股份有限公司  
 注册地址: 上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼  
 办公地址: 上海市浦东新区500号城建大厦26楼  
 法定代表人: 姚文平  
 联系人: 罗芳  
 电话: 021-68761616  
 传真: 021-68767981  
 客服电话: 400-8888-128  
 公司网站: www.tebon.com.cn  
 (90) 名称: 兴业证券股份有限公司  
 住所: 福州市湖东路99号标力大厦  
 法定代表人: 兰荣  
 联系人: 谢路霞  
 电话: 021-38565785  
 传真: 021-38565955  
 客户服务热线: 95562  
 公司网站: www.xyzq.com.cn  
 (91) 名称: 浙商证券股份有限公司  
 注册地址: 杭州市杭大路1号  
 办公地址: 杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层  
 法定代表人: 吴承  
 联系人: 谢淑娟  
 电话: 0571-87901063  
 传真: 0571-87901533  
 客服电话: 0671-96777  
 公司网站: www.stocke.com.cn  
 (92) 名称: 广州农村商业银行股份有限公司  
 注册地址: 广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦  
 办公地址: 广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦  
 法定代表人: 王雄基  
 联系人: 黎雄耀  
 联系电话: 020-29019593  
 业务传真: 020-29852692  
 客服热线: 020-961111  
 公司网站: www.grcbank.com  
 (93) 名称: 苏州银行股份有限公司  
 注册地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路728号  
 办公地址: 江苏省苏州市工业园区钟园路728号  
 法定代表人: 王兰凤  
 联系人: 熊志强  
 联系电话: 0512-69868390  
 业务传真: 0512-69868370  
 客服热线: 96067  
 公司网站: www.suzhoubank.com  
 (94) 名称: 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
 注册地址: 上海市虹口区 飞虹路360弄9号3724室  
 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴世纪大道80号时代金融中心8楼801  
 法定代表人: 汪静波  
 联系人: 方欣  
 联系电话: 021-360600735  
 业务传真: 021-36500777  
 客服热线: 400-1321-5309  
 公司网站: www.noah-fund.com  
 (95) 名称: 山西证券股份有限公司  
 住所: 山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼  
 法定代表人: 侯魏  
 联系人: 郭耀  
 电话: 0351-8896959  
 传真: 0351-8896919  
 客服电话: 400-666-1618、95573  
 公司网站: www.sj618.com.cn  
 (96) 名称: 兴业银行股份有限公司  
 注册地址: 福州市湖东路154号  
 办公地址: 上海市江宁路168号兴业大厦9楼  
 法定代表人: 高建平  
 联系人: 刘玲  
 电话: 021-52629999  
 客服电话: 95561, 或拨打当地咨询电话  
 公司网站: www.cib.com.cn  
 (97) 名称: 广发证券股份有限公司  
 注册地址: 广州天河区河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316 层)  
 办公地址: 广东省广州天河区北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼  
 法定代表人: 孙树明  
 联系人: 黄岚  
 电话: 020-87558888  
 传真: 020-87557985

客服电话: 96575或致电各地营业网点  
 公司网站: www.gtf.com.cn  
 (98) 名称: 中信期货有限公司  
 注册地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层  
 办公地址: 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层  
 法定代表人: 张皓  
 联系人: 洪斌  
 电话: 0755-23963913  
 传真: 0755-83217421  
 客服电话: 4009908826  
 公司网站: www.citicsf.com  
 (99) 名称: 北京乐融多源投资咨询有限公司  
 注册地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603  
 办公地址: 北京市朝阳区西大望路1号1号楼A座16层  
 法定代表人: 董浩  
 联系人: 于晓婷  
 电话: 138011217674  
 客服电话: 010-56400010  
 公司网站: www.jimufund.com  
 (100) 名称: 北京盈动利投资管理有限公司  
 注册地址: 北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341  
 办公地址: 北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341  
 法定代表人: 梁洪军  
 联系人: 李长军  
 电话: 13621232313  
 传真: 010-68854009  
 客服电话: 4008-196-665  
 公司网站: www.buyiforyou.com.cn  
 (101) 名称: 上海陆金所资产管理有限公司  
 注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元  
 办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼  
 法定代表人: 郭坚  
 联系人: 宁博宇  
 电话: 021-20665652  
 传真: 021-22066653  
 客服电话: 4008219031  
 公司网站: www.lufunds.com  
 (102) 名称: 徽商银行股份有限公司  
 注册地址: 合肥市芜湖路258号  
 办公地址: 合肥市芜湖路258号  
 法定代表人: 吴国华  
 联系人: 蔡芳  
 联系电话: 0651-62862801  
 业务传真: 0651-62862801  
 客服热线: 4008878707  
 公司网站: www.hsbq.net  
 (103) 名称: 宁波银行股份有限公司  
 住所: 宁波市鄞州区宁波南路700号  
 法定代表人: 陆华裕  
 联系人: 胡波勋  
 联系方式: 0574-89068340  
 传真: 0574-87050024  
 客服电话: 96528, 上海、北京地区962528  
 公司网站: www.nbcb.com.cn  
 (104) 名称: 北京顺诚基金销售有限公司  
 注册地址: 北京市朝阳区东三环芍药馆安富街6号  
 办公地址: 北京市朝阳区华严北里2号院民建大厦6层  
 法定代表人: 闫振杰  
 联系人: 翟云飞  
 联系电话: 010-52703350-6006  
 业务传真: 010-62020355  
 客服热线: 4008886661  
 公司网站: www.mytfund.com  
 (105) 名称: 深圳富济财富管理有限公司  
 注册地址: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
 办公地址: 深圳市南山区高新科技园七道惠恒集团二期418室  
 法定代表人: 齐小贺  
 联系人: 马佳伟  
 电话: 0755-83999907-815  
 传真: 0411-83999926  
 客服电话: 0755-83999907  
 公司网站: www.jinjiwealth.com  
 (106) 名称: 江苏汇丰农村商业银行股份有限公司  
 注册地址: 江苏省常州市天宁区中一路668号  
 办公地址: 江苏省常州市天宁区中一路668号  
 法人代表: 王国聚  
 联系人: 陈志刚  
 联系电话: 0519-89995001  
 业务传真: 0519-96005  
 传真: 0519-89995001  
 网址: www.jhbank.com  
 (107) 名称: 珠海盈米财富管理有限公司  
 注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491  
 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室  
 法定代表人: 肖雯  
 联系人: 黄敏娥  
 电话: 020-89629019  
 传真: 020-89629011  
 客服电话: 020-89629066  
 公司网站: www.yingmi.com  
 (108) 名称: 上海聚信资产管理有限公司  
 注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区新金桥北路277号3层310室  
 办公地址: 上海市长宁区福泉北路18号8号楼3层  
 法定代表人: 燕薇  
 联系人: 凌敏怡  
 电话: 021-52822063  
 传真: 021-52975270  
 客服电话: 4000-466-788  
 公司网站: www.66zichang.com  
 (109) 名称: 大连银行股份有限公司  
 注册地址: 大连市中山区中山路88号天安国际大厦49楼  
 办公地址: 大连市中山区中山路88号天安国际大厦9楼  
 法定代表人: 陈占维  
 联系人: 李鹏  
 电话: 0411-82308602  
 传真: 0411-82311420  
 客服电话: 4006640099  
 公司网站: www.bankofdl.com  
 (110) 名称: 上海付信金融服务有限公司  
 注册地址: 上海市黄浦区四川南路100号19层  
 办公地址: 上海市徐汇区虹园路1001号凯科国际大厦7-9层  
 法定代表人: 冯修敏  
 联系人: 陈云修  
 电话: 021-33323999-5611  
 传真: 021-33323837  
 客服电话: 400-820-2819  
 公司网址: https://tty.chinapainet.com  
 (111) 名称: 上海利得基金销售有限公司  
 注册地址: 上海市宝山区蕴川路5475号1033室  
 办公地址: 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  
 法定代表人: 沈健伟  
 联系人: 张裕  
 联系电话: 15801816961  
 客服热线: 4000676266  
 公司网站: www.leadfund.com.cn  
 (112) 名称: 开源证券股份有限公司  
 注册地址: 西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
 办公地址: 西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
 法定代表人: 李刚  
 联系人: 黄芳、袁伟涛  
 电话: 029-63387256  
 传真: 029-81876060  
 客服电话: 400-960-8966  
 公司网站: www.kysec.com  
 (113) 名称: 中国民族证券有限责任公司  
 注册地址: 北京市西城区金融大街5号新大厦A座6-9层  
 办公地址: 北京市西城区金融大街5号新大厦A座6-9层  
 法定代表人: 赵大建  
 联系人: 李敏  
 联系电话: 010-59355941  
 客服电话: 40088-95618  
 公司网站: www.s618.com.cn  
 (114) 名称: 光大证券股份有限公司  
 注册地址: 上海市静安区新闻路1508号  
 办公地址: 上海市静安区新闻路1508号  
 法定代表人: 薛峰  
 联系人: 刘晨  
 电话: 021-22169999  
 传真: 021-22169134  
 客服电话: 95525  
 公司网站: www.ebscn.com  
 (115) 名称: 上海凯石财富基金销售有限公司  
 注册地址: 上海市黄浦区西藏南路765号602-115室  
 办公地址: 上海市黄浦区西藏南路延安东路1号凯石大厦4楼  
 法定代表人: 陈维武  
 联系人: 李晓明  
 电话: 021-63333319  
 传真: 021-63332323  
 客服电话: 4000 178 000  
 公司网站: www.lingxiangfund.com  
 3、其他代销机构  
 本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。

名称: 广发基金管理有限公司  
 住所: 广东省珠海市横琴新区宝中3路4004-56室  
 法定代表人: 王石伟  
 办公地址: 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼  
 电话: 020-83988970  
 传真: 020-89899175  
 联系人: 李尔华  
 三、出具法律意见书的律师事务所  
 名称: 国浩律师(广州)事务所  
 住所: 广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦38层  
 负责人: 程秉  
 电话: 020-38799345  
 传真: 020-38799335  
 经办律师: 黄良、陈桂华  
 联系人: 程秉  
 四、审计基金资产的会计师事务所  
 名称: 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)  
 办公地址: 上海市延安中路222号外滩中心30楼  
 法人代表: 卢伯卿

联系人: 洪碧娟  
 电话: 021-61418888  
 传真: 021-63350003  
 经办注册会计师: 王明静、吴迪

**第四部分 基金名称**  
 广发中证全指地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

**第五部分 基金的类型**  
 ETF联接基金

本基金主要通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

**第六部分 基金的投资目标**  
 本基金以目标ETF基金份额的指数成份股及备选股份为主要投资对象,此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资比例为:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

**第八部分 基金的投资策略**  
 本基金为ETF联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本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控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

(一)资产配置策略  
 本基金主要投资于目标ETF,标的指数成份股、备选股份,其中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值90%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具,其目的是为了便于本基金在应付申购赎回的前提下,更好地跟踪标的指数。

本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产在各类资产上的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

(二)目标ETF投资策略  
 1.股票组合构建方式  
 本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申赎的方式或二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还可适度参与目标ETF 基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。当目标ETF申购、赎回或交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

2.投资组合的调整  
 本基金将根据开放日申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方式。(1)当净申购时,本基金将根据净申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建,目标ETF的申购或买入等;(2)当净赎回时,本基金将根据净赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出等。

(三)股票投资组合策略  
 1.股票组合构建原则  
 根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2.股票组合构建方法  
 本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选股份的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法,根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素限制,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对股票组合管理进行适当调整和替换,以更紧密的跟踪标的指数。

3.投资组合调整  
 (1)定期调整  
 本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期调整。

(2)不定期调整  
 基金经理将跟踪标的指数变动,基金组合跟踪偏离度情况,结合成份基金基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(四)债券投资策略  
 本基金将通过自上而下的宏观分析,结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类资产配置,并根据对个券相对价值的比较,进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。

(五)股指期货的投资策略  
 本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的空期合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期策略等实现套期保值操作。

本基金运用股指期货的形式主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。

(六)权证投资策略  
 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于提高基金资产的投资效率,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。

若未来法律法规或监管部门有新规定,本基金将按最新规定执行。

**第九部分 标的指数和业绩比较基准**  
 本基金以中证全指金融地产指数为标的指数。  
 本基金业绩比较基准为:95%×中证全指金融地产指数收益率+5%×银行活期存款利率(税后)。

由于本基金(税后)为被动投资的指数基金,跟踪标的为中证全指金融地产指数,因此本基金采用上述业绩比较基准。

如果中证全指金融地产指数被停止编制及发布,或中证全指金融地产指数由其他指数替代(单更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致中证全指金融地产指数不宜继续作为本基金的标的指数,基金管理人将在履行适当程序后,可以变更更名的标的指数的业绩比较基准,并在变更前提前2个工作日在中国证监会指定的媒体上公告。

**第十部分 基金收益特征**  
 本基金为ETF联接基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

**第十一部分 基金投资组合报告**  
 本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金管理人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2016年2月19日复核了本报告中的财务资料、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。

本投资组合报告所载数据截至2015年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,469,547.49	3.04
2	其中:股票	3,469,547.49	3.04
3	基金投资	77,031,617.78	68.62
4	固定收益投资	-	-
5	其中:债券	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	贵金属投资	-	-
8	买入返售金融资产	-	-
9	应收利息、应收股利、应收基金赎回款	-	-
10	其他金融资产	2,491,185.63	0.23
11	合计	88,301,832.65	100.00

2.期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	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	36,168.00	0.04
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	21,200	0.03
I	信息技术业	-	-
J	金融业	2,441,222.00	2.67
K	房地产业	886,386.49	1.01
L	租赁和商务服务业	6,957.00	0.01
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	38,204.00	0.03
合计		3,469,547.49	4.00

3.报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	603118	中国平安	7,800	280,800.00	0.32
2	000002	万科A	15,500	256,550.00	0.29
3	600016	民生银行	21,200	204,360.00	0.24
4	600196	兴业银行	9,500	182,160.00	0.19
5	600036	招商银行	7,400	133,120.00	0.15
6	600000	浦发银行	6,500	116,760.00	0.14
7	600030	中信证券	5,600	100,360.00	0.13
8	601328	交通银行	16,800	100,102.00	0.13
9	600627	上海复星	5,700	90,174.00	0.11
10	601168	华能国际	7,100	74,763.00	0.09

4.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	603118	中国平安	7,800	280,800.00	0.32
2	000002	万科A	15,500	256,550.00	0.29
3	600016	民生银行	21,200	204,360.00	0.24
4	600196	兴业银行	9,500	182,160.00	0.19
5	600036	招商银行	7,400	133,120.00	0.15
6	600000	浦发银行	6,500	116,760.00	0.14
7	600030	中信证券	5,600	100,360.00	0.13
8	601328	交通银行	16,800	100,102.00	0.13
9	600627	上海复星	5,700	90,174.00	0.11
10	601168	华能国际	7,100	74,763.00	0.09

5.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。

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.本基金本报告期末未持有债券。

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。

9.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。

10.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金本报告期末未进行股指期货交易。

11.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期末未进行国债期货交易。

12.投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没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。

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,218.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,162.16
5	应收申购款	2,639,241.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	3,242.06
9	合计	2,691,160.65

(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) 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	数量(股)	基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	266,515.00	0.30	重大停牌

**第十二部分 基金的业绩**  
 本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2015年12月31日。

1.本基金本报告期期末基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益比率比较