华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2016年3月28日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示
基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根假本基金合同规定,于2016年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。
本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告中的财务资料已经银计、普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。
本报告期自2015年06月30日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华宝万物互联混合
基金主代码	001534
交易代码	001534
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年6月30日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	975,922,306.52份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,通过捕捉互联网行业和体现互联思维相关行业的投资机会,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.大类资产配置策略 本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。 2.股票投资策略 本基金采取积极的股票选择策略,将"自上而下"的行业配置策略和"自下而上"的股票精选策略相结合,根据对宏观经济、中观行业和市场风险特征变化的判断,进行投资组合的动态优化,实现基金资产长期稳定增值。 3.固定收益类投资工具投资策略 本基金将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券等固定收益率投资工具,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。 4.权证投资策略 本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行系根操作,在风险可控的前提下力争实现稳健的超额收益。 5.股指期货投资策略 本基金将依据法律法规并根据风险管理的原则参与股指期货投资。本基金将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,采用流动性好、交易活跃的期货合约,并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征。 6.资产支持证券投资策略 本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 7.其他金融工具投资策略 如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他金融产品,基金管理人将根据监管机构的规定及本基金的投资目标,制定与本基金相适应的投资策略,比例限制,信息披露方式等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	田青
	联系电话	021-38505888	010-67596096
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tianqing.12h@ccb.com
客户服务电话		400-700-5588,021-38924558	010-67596096
传真		021-38505777	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

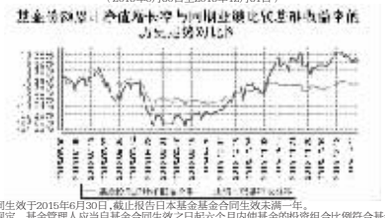
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年6月30日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	39,985,775.10
本期利润	94,181,220.25
加权平均基金份额本期利润	0.0766
本期加权平均净值利润率	8.07%
本期基金份额净值增长率	6.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	56,006,083.66
期末可供分配基金份额利润	0.0574
期末基金资产净值	1,043,205,084.48
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	6.90%

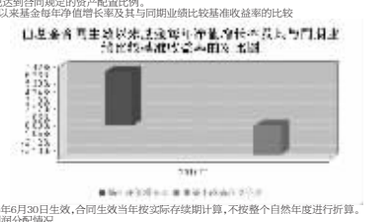
注:
1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.净值相关数据计算中涉及大数的,包括所有交易日以及季末最后一日然日(如非交易日)。
4.期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	29.58%	2.28%	9.92%	0.92%	19.66%	1.37%
过去六个月	6.90%	2.42%	-7.13%	1.47%	14.03%	0.95%
自基金合同生效起至今	6.90%	2.41%	-3.70%	1.50%	10.60%	0.91%

注:1.本基金业绩比较基准为:55%*沪深300指数收益率+45%*上证国债指数。
2.净值以及比较基准相关数据计算中涉及大数的,包括所有交易日以及季末最后一自然日(如非交易日)。
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
(2015年6月30日至2015年12月31日)



注:1.本基金基金合同生效于2015年6月30日,截止报告日本基金基金合同生效未满一年。
2、按照基金合同的规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。截至2015年12月30日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2015年6月30日生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金成立于2015年6月30日,基金成立至今未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及基金经理的经验
基金管理人是2003年3月7日正式成立的合资基金管理公司,截至本报告期末(2015年12月31 日),所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证100 基金、上证180价值ETF、上证180价值ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证180成长ETF、上证180成长ETF联接基金、华宝油气基金、华宝兴业医药生物基金、华宝兴业资源优选基金、华宝添益基金、华宝兴业服务优选基金、华宝兴业创新优选基金、华宝兴业生态中国基金、华宝兴业国际视野基金、华宝兴业量化对冲基金、华宝兴业高端制造基金、华宝兴业品质生活基金、华宝兴业稳健回报基金、华宝兴业事件驱动基金、华宝兴业国策导向、华宝兴业新价值、华宝兴业新机遇、华宝兴业医疗分级、华宝兴业1000分级、华宝兴业万物互联、华宝兴业中国互联网和华宝兴业转型升级基金,所管理的开放式证券投资基金资产净值合计182,703,481,955.16元。
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及其基金经理履职情况

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
楼鸣强	本基金基金经理、华宝服务优选混合基金经理	2015年6月30日	-	6年	硕士。曾在兴业证券研究所从事行业分析工作,2011年加入华宝兴业基金管理有限公司,先后担任分析师、基金经理助理的职务,2014年10月起担任华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金经理,2015年6月兼任华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期以及离任日期均以基金公告为准。
2.证券从业年限按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,本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,194,517,088.15份基金份额,其中认购资金利息折合32,159.89份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、资产支持证券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、所市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需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,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的0-95%投资于股票资产,其中,投资于万物互联主题相关股票的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的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%;股指期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。
本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于2016年3月24日批准报出。
4.2.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定以下合称"企业会计准则"、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告》、中国证券投资基金业协会以下简称"中国基金业协会"颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业万物互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。
7.4.4 重要会计政策和会计估计
7.4.4.1 会计年度
本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日。
7.4.4.2 记账本位币
本基金的记账本位币为人民币。
7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类
(1)金融资产的分类
金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。
本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。
本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。
(2)金融负债的分类
金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。
7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。
对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。
金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。
金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。
当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。
7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则
本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值:
(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。
(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。
(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。
7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销
本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债应抵销后的净额在资产负债表中列示。
7.4.4.7 实收基金
实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。
7.4.4.8 损益平准金
损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。
7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量
股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。
应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
7.4.4.10 费用的确认和计量
本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。
其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。
7.4.4.11 基金的收益分配政策
每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,在基本基金信息披露方式上,本基金将根据实际情况决定是否将其纳入可供分配的范围。若期末未分配利润中的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。
经宜告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。
7.4.4.12 分部报告
本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况,经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。
本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。
7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计
根据本基金的信息联网和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:
对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范开放式证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期未发生会计政策变更。
7.4.5.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期未发生会计估计变更。
7.4.5.3 差错更正的说明
本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。
7.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财政法规和实务操作,主要税项列示如下:
(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金卖出股票、债券的差价收入不征收营业税。
(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一按20%的税率计征个人所得税。
(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司("华宝兴业")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
华宝信托有限责任公司("华宝信托")	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
宝钢集团有限公司("宝钢集团")	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司("华宝证券")	受宝钢集团控制的公司
华宝投资有限公司("华宝投资")	受宝钢集团控制的公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
7.4.8 本报告期及上年度可比期间内关联方交易
7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金本期未通过关联方交易单元进行的交易。
7.4.8.2 关联方报酬
7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,796,107.81
其中:支付销售机构的客户维护费	3,000,73.03

注:
支付基金管理人华宝兴业基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。
7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,466,017.93

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。
7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年6月30日)持有的基金份额	940,202.72
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减:期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	940,202.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.10%

注:基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。
7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。
7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2015年6月30日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	259,994,564.59	1,538,732.11

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。
7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券的情况。
7.4.8.7 其他关联交易事项的说明
本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。
7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。
7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300222	科大智能	2015年8月21日	重大资产重组	20.84	2016年1月7日	21.16	2,092,990	46,562,644.39	43,617,911.60	-
002612	朗姿股份	2015年12月23日	重大事项	75.46	-	-	529,140	29,510,759.58	39,928,904.40	-
002502	骅威股份	2015年8月20日	重大资产重组	32.02	2016年1月14日	23.35	774,501	24,562,406.25	24,799,522.02	-

注:本基金截至2015年12月31日正持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。
7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本报告期末无银行间市场债券正回购,因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。
7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
(1)公允价值
(a)金融工具公允价值计量的方法
公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:
第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。
(b)持续的以公允价值计量的金融工具
(i)各层次金融工具公允价值
于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为713,147,400.58元,属于第二层次的余额为108,346,338.02 元,无属于第三层次的余额。
(ii)公允价值所属层次间的重大变动
对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。
(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额
无。
(c)非持续的以公允价值计量的金融工具
于2015年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。
(d)不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。
(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	821,493,738.60	75.44
	其中:股票	821,493,738.60	75.44
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	264,619,793.72	24.30
7	其他各项资产	2,841,145.97	0.26
8	合计	1,088,954,678.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,132,593.00	1.74
B	采矿业	-	-
C	制造业	442,792,596.89	42.45
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	31,370,520.08	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,323,534.18	0.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	203,083,228.96	19.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	39,798,272.91	3.81
L	租赁和商务服务业	10,732,080.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	131,631.28	0.01
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	71,129,281.30	6.82
S	综合	-	-
	合计	821,493,738.60	78.75

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。
期末投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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300222	科大智能	2,092,990	43,617,911.60	4.18
2	002612	朗姿股份	529,140	39,928,904.40	3.83
3	002188	新塘联	840,260	37,349,557.00	3.58
4	300248	新开普	855,700	31,789,255.00	3.05
5	300230	永利带业	842,600	31,487,962.00	3.02
6	300364	中文在线	154,954	27,581,812.00	2.64
7	300398	飞凯材料	317,733	25,285,192.14	2.42
8	002502	骅威股份	774,501	24,799,522.02	2.38
9	002381	双箭股份	1,436,525	24,535,847.00	2.35
10	002308	威创股份	973,147	23,988,073.55	2.30

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.fsfund.com的年度报告正文。
报告期内股票投资组合的重大变动
累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	300248	新开普	111,529,115.86	10.69
2	300347	泰格医药	104,371,725.50	10.00
3	300253	卫宁健康	90,618,627.73	8.69
4	300244	迪安诊断	81,759,424.91	7.84
5	002657	中科金财	79,379,129.87	7.61
6	300049	福瑞股份	73,988,897.32	7.09
7	000858	五粮液	68,709,923.78	6.59
8	300222	科大智能	67,065,360.89	6.43
9	300075	数字政通	63,051,874.81	6.04
10	300364	中文在线	59,603,370.52	5.71
11	002074	国轩高科	57,655,274.94	5.53
12	300295	三六五网	55,073,505.43	5.28
13	601211	国泰君安	54,708,600.50	5.24
14	300413	快乐购	54,285,573.91	5.20
15	600276	恒瑞医药	52,991,303.46	5.08
16	300059	东方财富	51,999,400.00	4.98
17	002462	嘉事堂	49,826,566.61	4.78
18	600827	百联股份	49,802,337.85	4.77
19	000568	泸州老窖	49,759,438.93	4.77
20	300133	华策影视	49,677,524.05	4.76
21	300468	四方精创	47,796,996.93	4.58
22	300439	美康生物	47,202,123.95	4.52
23	002022	科华生物	44,192,566.64	4.24
24	300336	新文化	44,029,284.75	4.22
25	300033	同花顺	42,572,781.00	4.08
26	300447	全信股份	42,402,401.42	4.06
27	600115	东方航空	41,041,894.18	3.93
28	600671	信雅达	40,740,303.09	3.91
29	002260	德奥通航	39,457,166.57	3.78
30	300016	北陆药业	39,202,948.07	3.76
31	300231	银信科技	38,868,697.01	3.73
32	600834	申通地铁	38,654,595.82	3.71
33	300130	新国都	38,601,758.07	3.70
34	600677	航天通信	36,186,911.59	3.47
35	600138	中青旅	36,133,000.68	3.46
36	002381	双箭股份	35,992,438.85	3.45
37	000547	航天发展	35,872,883.96	3.44
38	300426	唐德影视	34,257,308.57	3.29
39	300043	互动娱乐	33,093,788.88	3.17
40	300186	大华农	33,021,673.88	3.17
41	002466	天齐锂业	32,778,093.66	3.14
42	300238	冠昊生物	32,766,055.32	3.14
43	601166	兴业银行	32,527,626.72	3.12
44	002714	牧原股份	32,415,421.24	3.11
45	600820	隧道股份	32,259,591.11	3.09
46	300226	上海钢联	32,184,319.41	3.09
47	300251	光线传媒	31,970,067.78	3.06
48	300230	永利股份	31,637,685.02	3.03
49	600655	豫园商城	31,170,017.82	2.99
50	002188	新塘联	30,932,213.50	2.97
51	300155	安居宝	30,617,593.14	2.93
52	600016	民生银行	30,202,567.38	2.90
53	300045	华力创通	30,008,344.27	2.88
54	300144	宋城演艺	29,866,073.02	2.86
55	002095	生意宝	29,789,460.83	2.86
56	002612	朗姿股份	29,510,759.58	2.83
57	300450	先导智能	29,121,038.00	2.79
58	300409	道氏技术	29,