上证180交易型开放式指数证券投资基金

【2015】年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

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据本基金合同规定,于2016年3月22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。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安上证180ETF
基金主代码	510180
交易代码	510180
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2006年4月13日
基金管理人	华安基金管理有限公司
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	6,002,557,679.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2006年5月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	采取抽样复制的指数跟踪方法,即根据定量化的选股指标,选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合,并通过优化模型确定投资组合中个股的权重,以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数－"上证180指数"。
风险收益特征	本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证180指数,是股票基金中风险中等、收益中等的产品。

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		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

§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	2014年	2013年
本期已实现收益	3,278,697,211.73	4,323,843,777.76	665,227,632.08
本期利润	1,697,998,320.68	6,331,106,538.13	63,417,586.56
加权平均基金份额本期利润	0.370	1.055	0.004
本期基金份额净值增长率	1.42%	62.72%	-7.24%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	2.1296	1.8088	0.9456
期末基金资产净值	19,225,427,298.39	14,782,148,833.09	12,434,965,563.04
期末基金份额净值	3.2029	3.2075	2.0188

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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

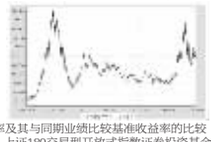
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.75%	1.60%	13.72%	1.60%	0.03%	0.00%
过去六个月	-16.55%	2.65%	-17.77%	2.65%	1.22%	0.00%
过去一年	1.42%	2.48%	-0.61%	2.49%	2.03%	-0.01%
过去三年	53.09%	1.81%	44.07%	1.82%	9.02%	-0.01%
过去五年	33.22%	1.61%	22.68%	1.62%	10.54%	-0.01%
自基金合同生效起至今	235.56%	1.91%	213.33%	1.94%	22.23%	-0.03%

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

上证180交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

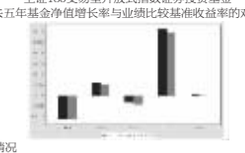
(2006年4月13日至2015年12月31日)



3.2.3 过去五年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

上证180交易型开放式指数证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015年	0.510	307,864,460.74	-	307,864,460.74	-
2014年	0.510	302,789,994.82	-	302,789,994.82	-
2013年	0.110	276,531,493.43	-	276,531,493.43	-
合计	1.130	887,185,948.99	-	887,185,948.99	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本1.5亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气(集团)总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至2015年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、华安上证龙头企业ETF联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证300指数(LOF)、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金(QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月月鑫短期理财债券、华安日日鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年红的基金经理,固定收益部副总监。

许之彦,指数投资部总监,理学博士,CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,现任华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安深证300指数证券投资基金(LOF)、华安易富黄金ETF及联接基金的基金经理,指数投资部总监。

陈 林,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CPA中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施2015年度的第一次分红,本次分红方案为:0.51元/10份。权益登记日:2015年11月17日;除息日:2015年11月18日;现金红利发放日:2015年11月23日。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配金额为307,864,460.74元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 单峰 周祎签字出具了普华永道中天审字(2016)第20883号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:上证180交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	102,775,326.06	75,109,414.83
结算备付金	2,337,885.24	2,864,231.50
存出保证金	2,075,439.77	263,408.51
交易性金融资产	19,133,891,185.16	14,713,863,886.96
其中:股票投资	19,132,883,626.76	14,713,863,886.96
基金投资	-	-
债券投资	1,007,558.40	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	25,740.22	5,746,183.14
应收利息	26,448.87	14,896.51
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	22,532.18
资产总计	19,241,132,025.32	14,797,884,553.63
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,511,782.41	3,052,630.33
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	8,181,121.86	5,569,439.37
应付托管费	1,636,224.38	1,113,887.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,783,259.68	1,801,261.58
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	592,338.60	4,198,501.38
负债合计	15,704,726.93	15,735,720.54
所有者权益:	-	-
实收基金	6,442,533,569.51	4,946,356,059.95
未分配利润	12,782,893,728.88	9,835,792,773.14
所有者权益合计	19,225,427,298.39	14,782,148,833.09
负债和所有者权益总计	19,241,132,025.32	14,797,884,553.63

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值3.2029元,基金份额总额6,002,557,679.00份。

7.2 利润表

会计主体:上证180交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	1,809,074,855.43	6,412,945,865.75
1.利息收入	2,917,676.91	328,352.84
其中:存款利息收入	2,916,986.38	325,342.50
债券利息收入	690.53	3,010.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,175,038,186.08	4,357,803,986.05
其中:股票投资收益	2,970,599,805.43	4,014,181,719.16
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	1,062,628.96
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	204,438,380.65	342,559,637.93
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-1,580,698,891.05	2,007,262,760.37
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	211,817,883.49	47,550,766.49
减:二、费用	111,076,534.75	81,839,327.62
1. 管理人报酬	75,614,570.22	61,801,910.57
2. 托管费	15,122,914.12	12,360,382.10
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	18,937,061.59	6,289,634.50
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	1,401,988.82	1,387,400.45
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,697,998,320.68	6,331,106,538.13
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,697,998,320.68	6,331,106,538.13

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:上证180交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,946,356,059.95	9,835,792,773.14	14,782,148,833.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,697,998,320.68	1,697,998,320.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	1,496,177,509.56	1,556,967,095.80	3,053,144,605.36
其中:1.基金申购款	64,904,480,861.65	155,412,820,919.57	220,317,301,781.22
2.基金赎回款	-63,408,303,352.09	-153,855,853,823.77	-217,264,157,175.86
四、本期向基金分额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-307,864,460.74	-307,864,460.74
五、期末所有者权益(基金净值)	6,442,533,569.51	12,782,893,728.88	19,225,427,298.39
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	6,611,041,365.71	5,823,924,197.33	12,434,965,563.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,331,106,538.13	6,331,106,538.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,664,685,305.76	-2,016,447,967.50	-3,681,133,273.26
其中:1.基金申购款	16,453,659,405.06	21,577,556,698.03	38,031,216,103.09
2.基金赎回款	-18,118,344,710.82	-23,594,004,665.53	-41,712,349,376.35
四、本期向基金分额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-302,789,994.82	-302,789,994.82
五、期末所有者权益(基金净值)	4,946,356,059.95	9,835,792,773.14	14,782,148,833.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:朱学华,主管会计工作负责人:章国富,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

上证180交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2006]第30号《关于同意上证180交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证180交易型开放式指数证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,072,807,826.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第35号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证180交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2006年4月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,072,822,105.00份基金份额,其中认购资金利息折合14,279.00份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为了与上证180指数进行对比,根据《上证180交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证180交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,华安基金管理有限公司确定2006年5月10日为本基金的基金份额折算日。当日上证180指数收盘值为2,919.214点,本基金资产净值为1,167,168,017.51元,折算前基金份额总额为1,072,822,105.00份,折算前基金份额净值为1.088元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为0.37268313,折算后基金份额总额为399,822,674.00份,折算后基金份额净值为2.919元。华安基金管理有限公司根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于2006年5月11日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证债字[2006]第39号文审核同意,本基金399,822,674.00份基金份额于2006年5月18日在上交所挂牌交易。

根据《上证180交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于华安上证180ETF实施份额拆分和修改基金合同的公告》的有关规定,本基金于2009年5月19日进行了基金份额拆分,拆分比例为10:1,并于2009年5月19日进行了变更登记。

根据《关于上证180ETF基金份额合并结果及恢复交易和申购、赎回的公告》的有关规定,中国证券登记结算有限责任公司按合并比例0.25对2013年12月19日(权益登记日)登记在册的本基金份额实施合并,减少基金份额持有人持有的基金份额数,并于2013年12月20日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证180交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的主要投资范围为标的指数上证180指数的成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的95%;同时力更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:上证180指数。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标ETF,于2009年9月29日募集成立了华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称"上证180ETF联接基金")。上证180ETF联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2016年3月23日批准报出。

7.4.2 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》、《上证180交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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年度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年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

对于正在交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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。上述所得统一适用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
华安基金管理有限公司("华安基金公司")	基金管理人、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、基金销售机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金("上证180ETF联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

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的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	75,614,570.22	61,801,910.57
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%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×0.5%/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1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,122,914.12	12,360,382.10

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0.1%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×0.1%/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

无。

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

无。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末2015年12月31日		上年度末2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上证180ETF联接基金	181,132,250.00	3.02%	253,534,499.00	5.50%

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	102,775,326.06	2,653,556.49	75,109,414.83	283,865.64

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

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间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

无。

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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600153	建发股份	2015-06-29	重大资产重组	17.31	-	-	644,757	13,108,038.83	11,160,743.67	-
601377	兴业证券	2015-12-29	配股	11.00	2016-01-07	9.40	11,812,932	114,698,167.57	129,942,252.00	-
600649	城投控股	2015-12-30	重要事项未公告	23.16	2016-01-07	20.84	4,236,052	57,396,281.77	98,106,964.32	-
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	55.91	-	-	1,605,136	91,621,071.20	89,743,153.76	-
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大资产重组	9.92	2016-02-01	8.93	8,811,641	96,781,699.61	87,411,478.72	-
601018	宁波港	2015-08-04	重大资产重组	8.16	2016-02-22	7.34	8,526,124	68,518,331.34	69,573,171.84	-
600645	中源协和	2015-12-30	重要事项未公告	65.01	2016-01-04	63.90	860,061	47,041,034.13	55,912,565.61	-
600873	梅花生物	2015-12-17	重要事项未公告	9.14	-	-	5,289,431	48,778,486.89	48,345,399.34	-
600219	南山铝业	2015-09-29	重要事项未公告	6.58	2016-01-25	7.00	5,679,703	41,532,163.11	37,372,445.74	-
600490	鹏欣资源	2015-08-28	重大资产重组	6.61	2016-03-02	7.27	2,224,052	19,429,749.60	14,700,983.72	-

注:本基金截至2015年12月31日止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

截至报告期末2015年12月31日止,本基金无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

截至报告期末2015年12月31日止,本基金无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) 基金申购款

于2015年度,本基金申购基金份额的对价总额为 220,317,301,781.22元,其中包括以股票支付的申购款 205,917,733,278.03元和以现金支付的申购款 14,399,568,503.19元(2014年度:对价总额为38,031,216,103.09元,其中包括以股票支付的申购款36,962,228,191.10元和以现金支付的申购款1,068,987,911.99元)。

(2) 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18,490,614,468.04元,属于第二层次的余额为 643,276,717.12元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次14,625,814,023.47元,第二层次88,049,863.49元,无第三层次)。

(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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),本基金于2015年3月30日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注7.4.5.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(iv) 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(2014年12月31日:同)。

(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。

(3) 除基金申购款和公允价值外,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	19,132,883,626.76	99.44
	其中:股票	19,132,883,626.76	99.44
2	固定收益投资	1,007,558.40	0.01
	其中:债券	1,007,558.40	0.01
	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	105,113,211.30	0.55
7	其他各项资产	2,127,628.86	0.01
8	合计	19,241,132,025.32	100.00

注:此处股票投资含可退替代款估值增值982元。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	57,769,031.70	0.30
B	采矿业	777,485,381.57	4.04
C	制造业	4,738,205,237.07	24.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	819,447,119.13	4.26
E	建筑业	994,731,650.81	5.17
F	批发和零售业	306,626,553.75	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	757,268,056.56	3.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	821,901,594.69	4.28
J	金融业	8,568,402,762.06	44.57
K	房地产业	1,034,371,593.89	5.38
L	租赁和商务服务业	71,045,031.91	0.37
M	科学研究和技术服务业	55,912,565.61	0.29
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	66,340,403.19	0.35
S	综合	63,375,662.82	0.33
	合计	19,132,882,644.76	99.52

8.2.2 积极投资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积极股票投资。

8.3 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

金额单位:人民币元

代码	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	601318	中国平安	30,761,213	1,107,403,668.00	5.76
2	600016	民生银行	83,921,133	808,999,722.12	4.21
3	601166	兴业银行	37,871,729	646,470,414.03	3.36
4	600036	招商银行	29,292,898	526,979,235.02	2.74