(上接B482版)

7.4.7.13.3债券投资收益——赎回差价收入

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
赎回基金份额对价总额	-	-
减:现金支付赎回款总额	-	-
减:赎回债券成本总额	-	-
减:赎回债券应收利息总额	-	-
赎回差价收入	-	-

注:本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.13.4债券投资收益——申购差价收入

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
申购基金份额对价总额	-	-
减:现金支付申购款总额	-	-
减:申购债券成本总额	-	-
减:申购债券应收利息总额	-	-
申购差价收入	-	-

注:本基金于本期及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.13.5资产支持证券投资收益

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减:卖出资产支持证券成本总额	-	-
减:应收利息总额	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注:本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14贵金属投资收益

7.4.7.14.1贵金属投资收益项目构成

注:本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注:本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3贵金属投资收益——赎回差价收入

注:本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4贵金属投资收益——申购差价收入

注:本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
卖出权证成交总额	-	-
减:卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

注:本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.15.2衍生工具收益 ——其他投资收益

单位:人民币元

项目	本期收益金额 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间收益金额 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日

注:本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
股票投资产生的股利收益	288,669.73	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	288,669.73	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位:人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
1.交易性金融资产	40,693,583.77	-315,873.86
——股票投资	41,246,454.02	367,599.30
——债券投资	-552,870.25	-683,473.16
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	40,693,583.77	-315,873.86

7.4.7.18 其他收入

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金赎回费收入	11,458,140.39	209,485.33
其他	48,807.82	-
合计	11,506,948.21	209,485.33

7.4.7.19 交易费用

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
交易所市场交易费用	1,034,158.14	130,436.45
银行间市场交易费用	30,152.50	-
合计	1,064,310.64	130,436.45

7.4.7.20 其他费用

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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	200,000.00	50,000.00
账户维护费	25,500.00	-
中登费用	-	2,466.55
其他	-	900.00
合计	285,500.00	103,366.55

7.4.7.21 分部报告

截至本期末,本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务,因此,无需作披露的分部报告。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
红塔红土基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、发起人
平安银行	基金托管人、基金销售机构
红塔证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
深圳市红塔资产管理有限公司	基金管理人的子公司
红塔期货有限责任公司	与基金管理人受同一母公司控制的公司
红证利德资本管理有限公司	与基金管理人受同一母公司控制的公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

–

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

金额单位: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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
红塔证券	117,690,767.62	17.76%	88,472,928.85	100.00%

7.4.9.1.2 债券交易

金额单位: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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
红塔证券	28,742,599.33	44.15%	125,645,398.53	100.00%

7.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位: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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
红塔证券	92,000,000.00	2.21%	1,146,500,000.00	100.00%

7.4.9.1.4 权证交易

金额单位: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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

注:本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
红塔证券	110,015.97	17.95%	289.58	0.11%

关联方名称	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
红塔证券	81,200.07	100.00%	80,512.03	100.00%

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,491,113.86	414,866.78
其中:支付销售机构的客户维护费	69,625.75	76,929.06

注:1、基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.20%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

2、于2015年12月31日的应付基金管理费为人民币1,525,016.19元。

7.4.9.2.2 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9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,477,315.23	86,430.59

注:1、基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

2、于2015年12月31日的应付托管费为人民币317,711.68元。

7.4.9.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

注:本基金产品无销售服务费。

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注:本基金于本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 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1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日
基金合同生效日(2014年9月18日)持有的基金份额	-	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
期间申购/买入总份额	26,929,084.38	-
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	36,929,084.38	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.31%	10.60%

注:1、基金管理人持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付;

2、根据《红塔红土盛世普益灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定,发起资金认购本基金的金额不少于人民币1,000万元,且发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。2014年9月18日(基金合同生效日),红塔红土基金公司运用固有资金作为发起资金认购的本基金份额为10,000,000.00份,占本基金发起式份额总量的10.60%。

7.4.9.4.2 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
红塔期货有限责任公司	-	-	10,000,200.00	10.60%
红证利德资本管理有限公司	20,462,929.50	2.39%	9,999,800.00	10.60%

注:其他关联方持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

7.4.9.5 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9月18日(基金合同生效日)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
平安银行	15,842,236.11	2,374,413.19	17,500,614.92	40,765.38

注:本基金本期的活期银行存款由基金托管人平安银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
上年度可比期间 2014年9月18日(基金合同生效日)至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额

注:本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.10 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300436	广生堂	2015年4月16日	2016年4月22日	老股转让	21.47	83.43	94,594	1,015,466.59	7,891,977.42	包含流通受限期内获得的送股数量47,297股
300443	金雷风电	2015年4月16日	2016年4月22日	老股转让	31.94	193.32	65,566	2,094,178.04	12,675,219.12	-
300463	迈克生物	2015年5月21日	2016年5月26日	老股转让	27.96	117.39	233,333	6,523,990.68	27,390,960.87	-

7.4.10.1.2 受限证券类别:债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.1.2 受限证券类别:债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

7.4.10.2 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
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项	55.91	-	-	40,000	2,021,861.40	2,236,400.00	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
合计				-	-

–

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

(2)其他事项

(a)公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(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人民币71,625,043.96元,属于第二层次的余额为人民币464,960,502.40元,无划分为第三层次余额。

(ii)公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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或第三层次。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<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>的通知》的规定,自2015年3月27日起,固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,交易所上市交易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)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

(iii)第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于2015年初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具,本基金2015年度未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(b)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	73,861,443.96	7.27
	其中:股票	73,861,443.96	7.27
2	固定收益投资	462,724,102.40	45.55
	其中:债券	462,724,102.40	45.55
	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	455,002,952.50	44.79
	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	16,154,198.78	1.59
7	其他各项资产	8,030,991.30	0.79
8	合计	1,015,773,688.94	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,199,000.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	63,699,414.73	6.32
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	222,304.44	0.02
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	2,588,208.18	0.26
J	金融业	4,060,400.00	0.40
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	109,392.21	0.01
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	982,724.40	0.10
S	综合	-	-
	合计	73,861,443.96	7.33

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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

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	300463	迈克生物	233,333	27,390,960.87	2.72
2	300443	金雷风电	65,566	12,675,219.12	1.26
3	300436	广生堂	94,594	7,891,977.42	0.78
4	002563	森马服饰	200,000	2,480,000.00	0.25
5	600271	航天信息	40,000	2,236,400.00	0.22
6	002299	圣农发展	100,000	2,199,000.00	0.22
7	002152	广电运通	70,000	2,169,300.00	0.22
8	601336	新华保险	40,000	2,088,400.00	0.21
9	002415	海康威视	60,000	2,063,400.00	0.20
10	601688	华泰证券	100,000	1,972,000.00	0.20
41	000877	天山股份	2,307,490.70	2.39
42	601968	宝钢包装	2,274,350.40	2.35
43	603116	红蜻蜓	2,244,765.48	2.32
44	600780	通宝能源	2,223,066.57	2.30
45	600382	广东明珠	2,216,418.00	2.29
46	600886	国投电力	2,203,000.00	2.28
47	600054	黄山旅游	2,170,102.07	2.25
48	300438	鹏辉能源	2,062,221.54	2.13
49	600019	宝钢股份	2,043,571.46	2.12
50	603308	应流股份	2,016,702.00	2.09
51	002450	康得新	1,999,591.24	2.07
52	603979	金诚信	1,995,179.60	2.07

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	16,476,468.00	17.05
2	601288	农业银行	13,518,000.00	13.99
3	601398	工商银行	12,420,000.00	12.85
4	601939	建设银行	11,050,092.40	11.44
5	002241	歌尔声学	10,319,743.16	10.68
6	002065	东华软件	10,257,154.81	10.62
7	002152	广电运通	9,332,784.22	9.66
8	600271	航天信息	9,095,747.88	9.41
9	000333	美的集团	8,941,599.00	9.25
10	002299	圣农发展	7,487,973.00	7.75
11	601628	中国人寿	7,218,041.90	7.47
12	601336	新华保险	6,910,037.85	7.15
13	300463	迈克生物	6,523,990.68	6.75
14	002563	森马服饰	6,515,422.00	6.74
15	002415	海康威视	5,676,211.03	5.87
16	600048	保利地产	5,434,729.00	5.62
17	601328	交通银行	5,205,978.00	5.39
18	600588	用友网络	5,036,432.00	5.21
19	600519	贵州茅台	4,545,694.00	4.70
20	601688	华泰证券	4,455,602.46	4.61
21	600703	三安光电	4,296,353.00	4.45
22	600138	中青旅	4,138,895.00	4.28
23	000651	格力电器	3,549,000.00	3.67
24	601166	兴业银行	3,330,494.00	3.45
25	300115	长盈精密	3,259,106.00	3.37
26	600585	海螺水泥	3,204,011.00	3.32
27	002292	奥飞动漫	3,183,752.00	3.30
28	600038	中直股份	3,114,180.00	3.22
29	000002	万 科A	2,989,714.00	3.09
30	000402	金 融 街	2,909,000.00	3.01
31	002081	金 螳 螂	2,692,953.01	2.79
32	603989	艾华集团	2,605,058.62	2.70
33	002285	世联行	2,603,813.00	2.69
34	002033	丽江旅游	2,574,766.28	2.66
35	600642	申能股份	2,392,830.00	2.48
36	600019	宝钢股份	2,360,707.00	2.44
37	600239	云南城投	2,305,053.00	2.39
38	600886	国投电力	2,290,000.00	2.37
39	300462	华铭智能	2,277,054.00	2.36
40	000712	锦龙股份	2,276,636.00	2.36
41	600780	通宝能源	2,178,551.21	2.25
42	002037	久联发展	2,178,198.00	2.25
43	600382	广东明珠	2,174,160.00	2.25
44	002305	南国置业	2,171,890.00	2.25
45	600054	黄山旅游	2,107,451.00	2.18
46	300443	金雷风电	2,094,178.04	2.17
47	600096	云天化	2,082,912.00	2.16
48	600489	中金黄金	2,081,200.00	2.15
49	002450	康得新	2,017,324.00	2.09
50	300043	互动娱乐	1,946,773.00	2.01

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601988	中国银行	16,465,919.00	17.04
2	601288	农业银行	13,586,000.00	14.06
3	601398	工商银行	12,472,000.00	12.91
4	601939	建设银行	11,351,624.94	11.75
5	002241	歌尔声学	10,158,135.56	10.51
6	002065	东华软件	9,149,535.37	9.47
7	000333	美的集团	9,028,595.00	9.34
8	601628	中国人寿	6,788,659.60	7.03
9	002152	广电运通	6,460,556.70	6.69
10	600271	航天信息	6,261,359.38	6.48
11	600588	用友网络	6,111,236.45	6.33
12	601328	交通银行	5,601,230.90	5.80
13	002299	圣农发展	5,503,984.88	5.70
14	600048	保利地产	4,908,498.06	5.08
15	603989	艾华集团	4,471,825.37	4.63
16	601336	新华保险	4,302,484.00	4.45
17	002563	森马服饰	4,192,867.00	4.34
18	600138	中青旅	4,173,154.10	4.32
19	002756	永兴特钢	3,848,954.92	3.98
20	600038	中直股份	3,792,759.04	3.93
21	000651	格力电器	3,616,145.37	3.74
22	002415	海康威视	3,563,463.00	3.69
23	000002	万 科A	3,497,459.83	3.62
24	002292	奥飞动漫	3,462,871.00	3.58
25	603025	大豪科技	3,300,570.00	3.42
26	600585	海螺水泥	3,160,565.74	3.27
27	002081	金 螳 螂	2,971,731.63	3.08
28	601166	兴业银行	2,964,000.00	3.07
29	000402	金 融 街	2,837,852.41	2.94
30	300115	长盈精密	2,797,843.65	2.90
31	600519	贵州茅台	2,767,288.44	2.86
32	300446	乐凯新材	2,709,898.12	2.80
33	002033	丽江旅游	2,684,958.99	2.78
34	601368	绿城水务	2,658,954.33	2.75
35	600703	三安光电	2,552,996.20	2.64
36	600642	申能股份	2,422,900.00	2.51
37	300028	金亚科技	2,390,433.00	2.47
38	002751	易尚展示	2,388,044.00	2.47
39	600096	云天化	2,345,692.00	2.43
40	603227	雪峰科技	2,319,629.42	2.40

7.4.10.2 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
600271	航天信息	2015年10月12日	重大事项	55.91	-	-	40,000	2,021,861.40	2,236,400.00	-

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
合计				-	-

–

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

(2)其他事项

(a)公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(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人民币71,625,043.96元,属于第二层次的余额为人民币464,960,502.40元,无划分为第三层次余额。

(ii)公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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或第三层次。根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<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>的通知》的规定,自2015年3月27日起,固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,交易所上市交易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)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

(iii)第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于2015年初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具,本基金2015年度未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(b)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	73,861,443.96	7.27
	其中:股票	73,861,443.96	7.27
2	固定收益投资	462,724,102.40	45.55
	其中:债券	462,724,102.40	45.55
	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	455,002,952.50	44.79
	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	16,154,198.78	1.59
7	其他各项资产	8,030,991.30	0.79
8	合计	1,015,773,688.94	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,199,000.00	0.22
B	采矿业	-	-
C	制造业	63,699,414.73	6.32
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	222,304.44	0.02
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	2,588,208.18	0.26
J	金融业	4,060,400.00	0.40
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	109,392.21	0.01
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	982,724.40	0.10
S	综合	-	-
	合计	73,861,443.96	7.33

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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

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	300463	迈克生物