

上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金

2015 年 度 报 告 摘 要

注:投资者欲了解本报告期末投资的所有股票明细,应阅读登载于www.lionfund.com.cn网站的年度报告正文。

1.1.2 期末影响投资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投资的情况。

1.2 报告期内股票投资组合的重大变动
1.2.1 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	601179	中国西电	6,037,369.00	2.02
2	601118	XID南模	5,871,166.00	1.97
3	601012	康希股份	5,723,249.00	1.92
4	600037	歌华有线	3,745,542.45	1.26
5	600875	东方电气	3,457,367.00	1.16
6	601727	上海电气	3,214,280.00	1.08
7	601004	上汽集团	2,999,428.10	1.01
8	600637	百视通	2,648,044.31	0.89
9	600276	恒瑞医药	2,608,697.24	0.87
10	600549	厦门国贸	2,604,941.92	0.87
11	600066	宇通客车	2,503,601.49	0.84
12	600111	北方稀土	2,436,277.29	0.82
13	600309	万华化学	2,435,834.62	0.82
14	600535	天士力	2,386,225.00	0.80
15	600031	三一重工	2,232,738.00	0.75
16	600008	首创股份	2,232,145.98	0.75
17	600196	复星医药	2,225,517.46	0.75
18	600150	中国船舶	2,060,170.00	0.69
19	600689	特变电工	2,041,360.00	0.68
20	600659	江苏有线	2,040,367.40	0.68

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,不考虑相关交易费用。

1.2.2 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	601766	中国南车	33,056,303.79	11.08
2	600037	歌华有线	6,684,048.61	2.24
3	600388	龙净环保	6,341,833.00	2.13
4	601727	上海电气	4,615,122.86	1.55
5	601299	中国铁建	4,245,151.26	1.42
6	601106	中国一重	4,123,311.19	1.38
7	600436	片仔癀	3,812,392.51	1.28
8	603328	依顿电子	3,353,152.40	1.12
9	600879	航天电子	2,565,285.71	0.86
10	600079	人福医药	2,123,192.86	0.71
11	600518	康美药业	2,110,740.20	0.71
12	600770	综艺股份	1,992,316.30	0.67
13	600267	海正药业	1,902,846.62	0.64
14	600435	北方导航	1,767,064.75	0.59
15	600276	恒瑞医药	1,669,010.98	0.54
16	600118	中国卫星	1,547,125.22	0.52
17	600066	宇通客车	1,411,586.89	0.47
18	600893	中航动力	1,252,211.00	0.42
19	600498	烽火通信	1,236,744.49	0.41
20	600008	首创股份	1,155,081.31	0.39

注:本期累计卖出金额按卖出成交金额,不考虑相关交易费用。

1.2.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元		
买入股票成本(成交)总额	111,735,045.38	
卖出股票收入(成交)总额	117,033,698.85	

注:买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。

1.3 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投资。

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

1.7 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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

1.8 报告期末本基金投资的股指期货投资情况说明
本基金本报告期末未投资股指期货。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明
本基金本报告期末未投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注
1.10.1 本基金本报告期投资的前十名证券的发行主体,本期没有出现被监管部门立案调查的情形,也没有出现被监管部门立案调查后,在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1.10.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

注:本基金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。

1.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6 投资组合报告附注
1.10.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.4 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。

1.10.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.4 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。

1.10.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	15,609.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,105.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,714.70

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.4 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。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6 投资组合报告附注
1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.1 本基金本报告期投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.2 本基金本报告期前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.6.3 期末其他各项资产构成

报告期内,无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。	
4.4	基金投资策略的改变
本报告期内,基金的投资组合策略没有重大改变。	
4.5	为基金进行审计的会计师事务所情况