

# 长城双动力混合型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

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 26 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 03 月 24 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 01 月 01 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	长城双动力混合
基金主代码	200010
交易代码	200010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 1 月 15 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
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	593,374,534.04 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金自 2015 年 8 月 3 日起由“长城双动力股票型证券投资基金”更名为“长城双动力混合型证券投资基金”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”，并相应修改基金合同和托管协议，详见本管理人 2015 年 8 月 3 日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更基金名称、基金类别并相应修改基金合同条款的公告》。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	充分挖掘上市公司从内生性增长到外延式扩张过程中产生的投资机会，追求基金资产的长期增值。
投资策略	采用“自下而上、个股优选”的投资策略，运用长城基金上市公司价值创造评估系统分析上市公司内生性增长潜力与外延式扩张潜质，选择以内生性增长为基础或具备外延式扩张能力的优秀上市公司构建并动态优化投资组合。
业绩比较基准	75%×标普中国 A 股 300 指数收益率+25%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，主要投资于具有内生性增长潜力或外延式扩张潜质的优势上市公司。属于预期风险收益较高的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金，低于股票型基金。

注：自基金合同生效至 2015 年 9 月 30 日本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率；自 2015 年 10 月 1 日至 2015 年 11 月 1 日本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中证综合债指数收益率；自 2015 年 11 月 2 日起本基金的业绩比较基准为：75%×标普中国 A 股 300 指数收益率+25%×中证综合债指数收益率。详见本管理人 2015 年 9 月 30 日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》及 2015 年 11 月 2 日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准因指数更名进行相应调整的公告》。

## 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		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	田青
	联系电话	0755-23982338	010-67595096
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275865

## 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.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 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	284,051,622.26	67,417,963.69	26,178,606.21
本期利润	301,630,880.82	44,791,945.38	33,751,125.66
加权平均基金份额本期利润	0.7120	0.2323	0.2516
本期基金份额净值增长率	88.80%	19.00%	27.74%
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	1.3580	0.2918	0.1541
期末基金资产净值	1,447,187,554.36	225,331,178.41	195,114,064.95
期末基金份额净值	2.4389	1.2918	1.1541

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上述基金业绩指标不包括持有人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。

### 3.2 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

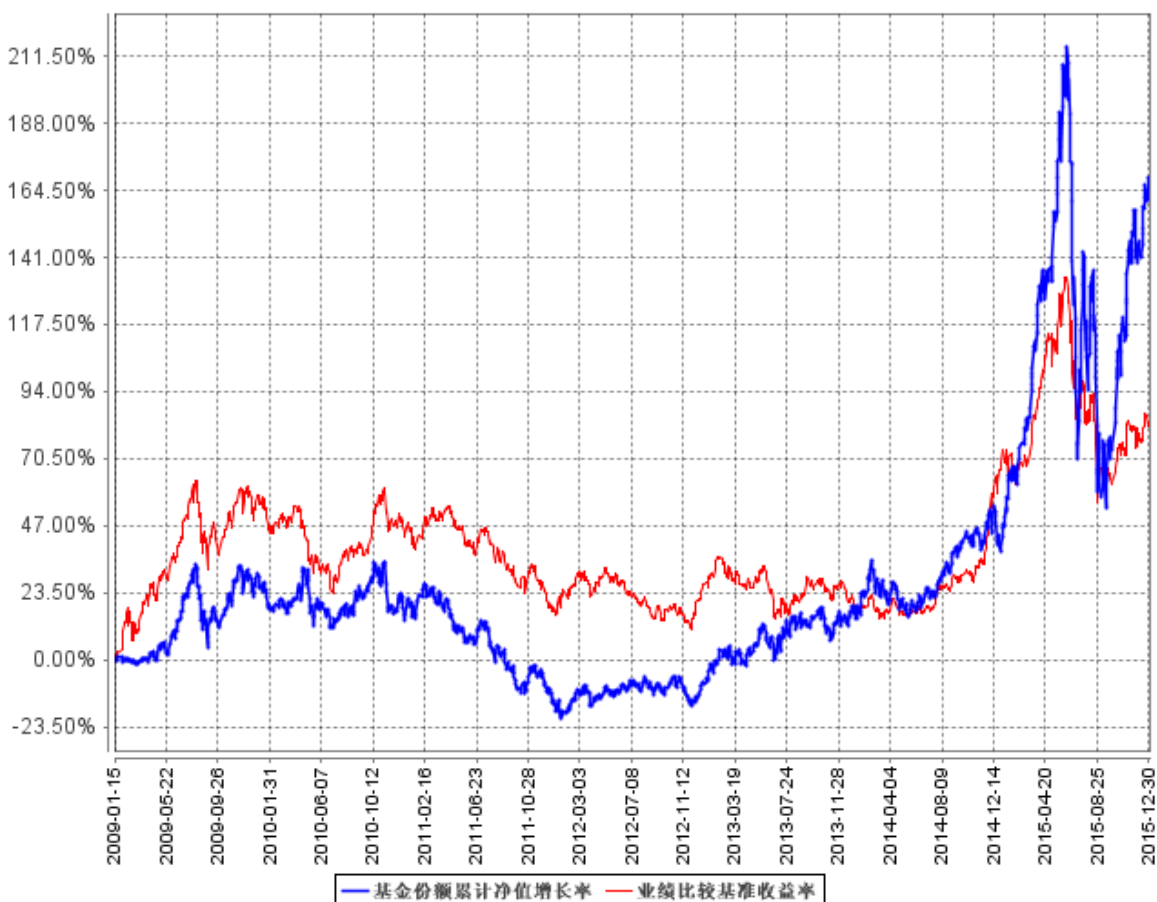
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

过去三个月	51.63%	2.29%	11.93%	1.18%	39.70%	1.11%
过去六个月	13.12%	3.76%	-11.33%	1.94%	24.45%	1.82%
过去一年	88.80%	3.10%	7.37%	1.82%	81.43%	1.28%
过去三年	186.98%	2.09%	43.61%	1.31%	143.37%	0.78%
过去五年	124.37%	1.77%	24.47%	1.18%	99.90%	0.59%
自基金合同生效起至今	165.07%	1.68%	81.84%	1.23%	83.23%	0.45%

注：自基金合同生效至 2015 年 9 月 30 日本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率；自 2015 年 10 月 1 日至 2015 年 11 月 1 日本基金的业绩比较基准为：75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中证综合债指数收益率；自 2015 年 11 月 2 日起本基金的业绩比较基准为：75%×标普中国 A 股 300 指数收益率+25%×中证综合债指数收益率。详见本管理人 2015 年 9 月 30 日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》及 2015 年 11 月 2 日发布的《长城基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准因指数更名进行相应调整的公告》。

### 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

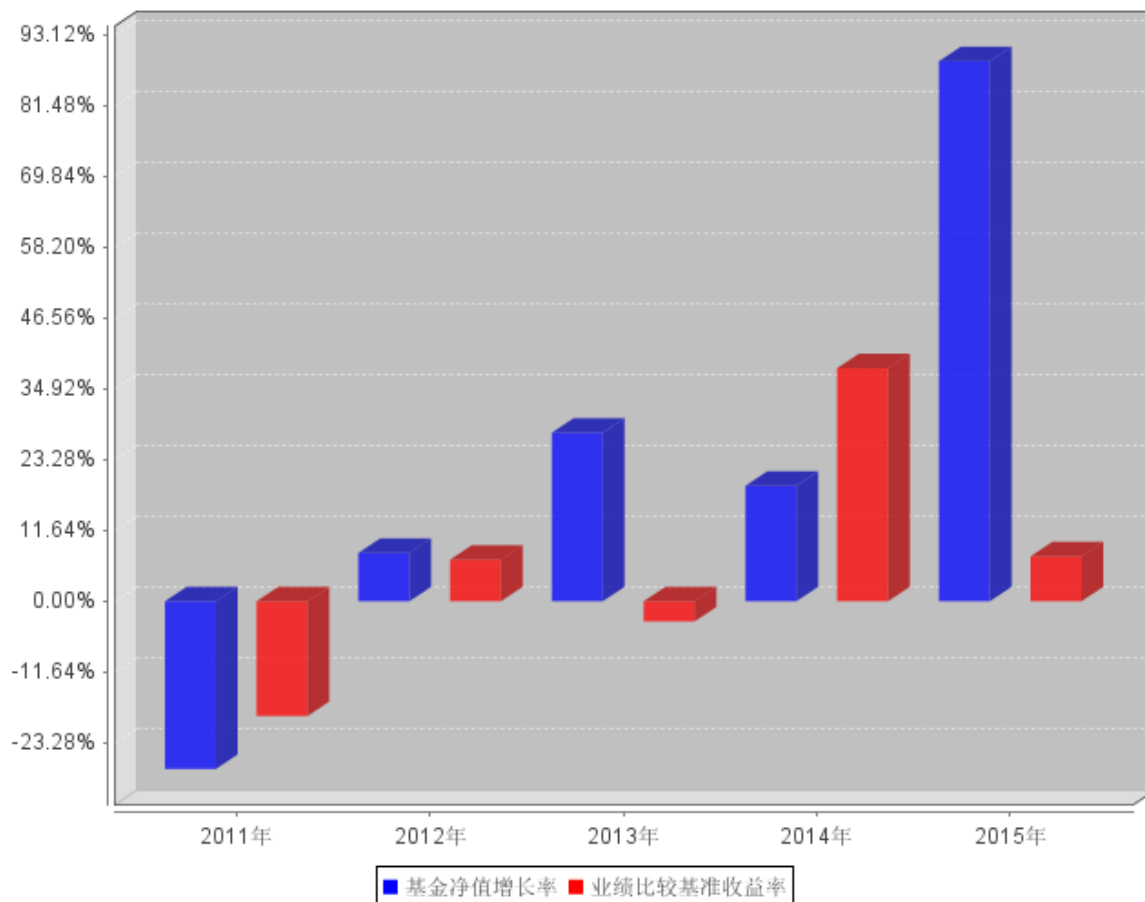
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同规定本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产 60%—95%，权证投资占基金资产 0%—3%，债券占基金资产 0%—35%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 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

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	-	-	-	-	
2014	0.8000	12,758,002.44	6,159,163.07	18,917,165.51	
2013	-	-	-	-	
合计	0.8000	12,758,002.44	6,159,163.07	18,917,165.51	

## § 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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城保本混合型证券投资基金、长城岁岁金理财债券型证券投资基金、长城久利保本混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城淘金一年期理财债券型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫保本混合型证券投资基金、长城久盈纯债分级债券型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠保本混合型证券投资基金、长城久祥保本混合型证券投资基金、长城新策略灵活配置混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
吴文庆	公司研究部副总经理、长城	2013 年 12 月 26 日	-	6 年	男，中国籍，上海交通大学

	久恒、长城双动力、长城消费、长城新兴产业、长城环保、长城改革红利基金的基金经理			生物医学工程博士。2010年进入长城基金管理有限公司，曾任研究部行业研究员，“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理助理。
--	---	--	--	--

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《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，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城双动力混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。



### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年的行情在加杠杆、去杠杆、互联网+、智能硬件、虚拟现实、救市等影响下，上演了一段轰轰烈烈的牛市，悲伤欲绝的熊市和“带来希望”的反弹市。一年的行情几乎演绎了从 06 年到 09 年四年的精华。上半年在融资、配资的推动下，在全民创新的热情下，以互联网为代表的企业不断的创出让人瞠目结舌的股价记录，指数一直扶摇直上了 5000 点，期间几乎没有像样的回调。之后在监管层对融资的加强监管，内幕交易和市场操纵的稽查，使得市场在去杠杆化的过程中，迎来了激烈的暴跌，爆仓、平仓此起彼伏。短短半个月，许多股票被腰斩。之后政府开始主导救市，筹措救市资金，市场开始走稳，9 月之后开始迎来反弹。

本基金在全年配置新兴产业相关的股票，并辅以医药、白酒作为底仓配置，在季度中对热点的板块和个股进行了一定程度的波段操作。在股灾期间因为很多股票停牌自救，加上平仓盘的杀跌，流动性很差，没有及时的减仓，导致年中回撤较大。基金在之后抓住了 9 月来的反弹，使得净值回升较快，全年获得了较好的表现。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金业绩在同类可比的基金中排名位于偏上水平。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体来看，A 股的中长期因素并没有发生根本的变化。宏观层面，国内仍然面临传统行业产能过剩，房价高企，地方融资平台迎来偿债期等重重困难，国家 16 年开始推行供给侧改革，但实际效果还有待观察；另一方面，国家在不同场合都表态要加大新兴产业扶植力度，各项制度设计不断向其倾斜，一二级市场关于新产业、新技术的投资此起彼伏。国家能否从制造业大国转型成

为创业大国，制造强国还需要时间验证。长期来看，中国经济要保持可持续健康的发展，市场化去产能、地方政府去杠杆、真心实意的市场化改革是未来中国根本希望所在，也是下一波健康牛市的根本基础。

从操作策略上来讲，一月在熔断、清盘、调仓等一系列的影响下，大盘呈现断崖式下跌，有的行业下跌超过 30%，个股下跌超过 50%的也比比皆是。两市两融也不断下降，农行关闭 P2P 接口，金融市场对创新进一步加强监管，杠杆被进一步清理。目前市场悲观情绪蔓延，两市成交量持续萎缩，市场对国家在汇率、利率、改革方面的控制力信心不足，市场以暴跌来应对。

目前市场跌到这个位置，我们认为悲观的情绪已经得到了释放，我们对后市不会过于悲观，我们认为接下来日本负利率、欧洲量宽、美国不加息，外部环境好转，国内情绪会好转，在这个时候更应该好好的仔细甄别真成长，对好的公司应该保持持续地跟踪和调研。具体来讲，我们仍会以确定性成长的医药、家电等大消费作为核心持仓，此外，我们看好中国制造业升级，工业自动化需求对相关产业的推动，我们会加大对机器人、工控相关技术领先企业的跟踪和关注；经济可持续健康发展对环保和节能的要求也是我们重点关注的投资方向。总的来说，本基金仍会坚守具有核心竞争力的价值型行业作为本基金核心持仓，同时选择受益于经济转型并具备持续成长能力的行业作为进攻组合，中长线布局，保持耐心，控制仓位，规避风险，力争为持有人作出更好业绩回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。

受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金会计凭借其专业技能和对市场产品长期丰富的估值经验以及对相关法律法规的熟练掌握，对没有市价的投资品种的估值方法在其专业领域提供专业意见。基金经理及研究员凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，对没有市价的投资品种综合宏观经济、行业发展、及个股状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。金融工程人员根据受托资产估值委员会提出的多种估值方法预案，利用金融工程研究体系各种经济基础数据和数量化工具，针对不同的估值方法及估值模型进行演算，为估值委员会寻找公允的、操作性较强的估值方法提供数理

依据。监察稽核人员对估值委员会做出的决议进行合规性审查，对估值委员提交的基金估值信息披露文件进行合规性审查。

受托资产估值委员会成员均具有五年以上证券、基金行业工作经验，具备专业胜任能力；基金会计具有会计从业资格和基金行业从业资格，精通基金估值政策、流程和标准，具有五年以上基金估值和会计核算工作经验；基金经理和研究员均拥有五年以上基金、证券投资工作经验，精通投资、研究理论知识和工具方法。

#### 2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突 估值委员会秉承基金持有人利益至上的宗旨，在估值方法的选择上力求客观、公允，在数据的采集方面力求公开、获取方便、操作性强、不易操纵。本基金管理人旗下管理的基金，其参与估值流程各方之间不存在任何重大的利益冲突。

#### 4、已签约的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署估值数据服务协议，由其按约定提供债券品种的估值数据。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

## § 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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了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：长城双动力混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		172,223,967.26	28,414,722.56
结算备付金		10,144,671.01	1,255,526.32
存出保证金		1,202,319.43	134,205.89
交易性金融资产		1,335,476,598.99	202,329,283.75
其中：股票投资		1,335,476,598.99	202,329,283.75
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	2,270,970.73
应收利息		29,731.65	5,987.48
应收股利		-	-
应收申购款		2,519,519.57	503,143.06
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-

资产总计		1, 521, 596, 807. 91	234, 913, 839. 79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
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		66, 053, 143. 93	6, 507, 088. 70
应付赎回款		1, 274, 846. 20	1, 751, 468. 88
应付管理人报酬		1, 632, 438. 85	331, 456. 79
应付托管费		272, 073. 13	55, 242. 79
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5, 032, 641. 31	787, 528. 37
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		144, 110. 13	149, 875. 85
负债合计		74, 409, 253. 55	9, 582, 661. 38
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		593, 374, 534. 04	174, 429, 440. 03
未分配利润		853, 813, 020. 32	50, 901, 738. 38
所有者权益合计		1, 447, 187, 554. 36	225, 331, 178. 41
负债和所有者权益总计		1, 521, 596, 807. 91	234, 913, 839. 79

注: 报告截止日 2015 年 12 月 31 日, 基金份额净值人民币 2. 4389 元, 基金份额总额 593, 374, 534. 04 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 长城双动力混合型证券投资基金

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	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至	2014 年 1 月 1 日至
		2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		337, 888, 151. 78	52, 255, 746. 52
1. 利息收入		833, 564. 60	325, 470. 89
其中: 存款利息收入		833, 564. 60	216, 352. 32
债券利息收入		-	109, 118. 57
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）		318,215,888.65	74,262,593.19
其中：股票投资收益		315,310,650.91	71,530,368.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	32,063.50
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		2,905,237.74	2,700,160.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		17,579,258.56	-22,626,018.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,259,439.97	293,700.75
<b>减：二、费用</b>		36,257,270.96	7,463,801.14
1. 管理人报酬		12,828,566.93	3,611,045.26
2. 托管费		2,138,094.45	601,840.89
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		20,923,664.35	2,887,993.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		366,945.23	362,921.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		301,630,880.82	44,791,945.38
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		301,630,880.82	44,791,945.38

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城双动力混合型证券投资基金

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）	174,429,440.03	50,901,738.38	225,331,178.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	301,630,880.82	301,630,880.82



于核准长城双动力股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长城基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 1 月 15 日正式生效，首次设立募集规模为 485,751,247.50 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。根据 2014 年 8 月 8 日开始施行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《关于实施〈公开募集证券投资基金运作管理办法〉有关问题的规定》以及基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，长城基金管理有限公司决定自 2015 年 8 月 3 日起，将“长城双动力股票型证券投资基金”，更名为“长城双动力混合型证券投资基金”，基金类别由“股票型”变更为“混合型”。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准为： $75\% \times \text{标普中国 A 股 300 指数收益率} + 25\% \times \text{中证综合债指数收益率}$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计除以下说明的内容外其余均与最近一期年度报告相一致：



本基金本报告期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，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。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

##### 3. 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行

和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

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。

#### 7.4.8 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

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 1 月 1 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
长城证券	1,072,247,031.28	7.65%	60,823,586.74	3.20%
东方证券	1,514,286,831.32	10.80%	-	-

##### 7.4.8.1.2 债券交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 7.4.8.1.4 权证交易

注：本基金于本期及上年度可比期间，均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 7.4.8.1.5 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
长城证券	976,175.55	7.56%	-	-
东方证券	1,399,202.28	10.84%	917,643.49	18.23%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1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
长城证券	55,373.62	3.20%	-	-
东方证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等。)

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 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	12,828,566.93
其中：支付销售机构的客户维护费	877,904.43	536,478.82

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 1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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) 本期末本基金未支付的管理费余额人民币 1,632,438.85 元。(2014 年末:人民币 331,456.79 元)

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	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	2,138,094.45	601,840.89

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:

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 本期末本基金未支付的托管费余额人民币 272,073.13 元。(2014 年末:人民币 55,242.79 元)

#### 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

注:本基金于本期及上年度可比期间,均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	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2009 年 1 月 15 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	13,170,699.28	13,170,699.28
期间申购/买入总份额	4,301,200.15	-
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	17,471,899.43	13,170,699.28
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.94%	7.55%

#### 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

注：除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 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	172, 223, 967. 26	732, 706. 95	28, 414, 722. 56	203, 734. 54

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

注：本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 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

注：本基金于本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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
002228	合兴包装	2015 年 8 月 4 日	重大事项	19. 52	2016 年 2 月 2 日	15. 21	1, 652, 707	56, 258, 101. 71	32, 260, 840. 64	-
600603	大洲兴业	2015 年 9 月 11 日	重大事项	18. 60	2016 年 1 月 14 日	13. 55	1, 199, 821	28, 495, 005. 71	22, 316, 670. 60	-
600584	长电科技	2015 年 11 月 30 日	重大事项	22. 02	-	-	799, 901	17, 607, 125. 74	17, 613, 820. 02	-

##### 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

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

## 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 7.4.10.1 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。

### 7.4.10.2 其他事项

#### (1) 公允价值

管理层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。

#### 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划分为第一层次的余额为人民币 1,263,285,267.73 元，划分为第二层次的余额为人民币 72,191,331.26 元，无划分为第三层次余额。于 2014 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划分为第一层次的余额为人民币 194,551,233.75 元，划分为第二层次的余额为人民币 7,778,050.00 元，无划分为第三层次余额。

#### 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还是第三层次。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 25 日起，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。

#### 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(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	1,335,476,598.99	87.77
	其中：股票	1,335,476,598.99	87.77
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	182,368,638.27	11.99
7	其他各项资产	3,751,570.65	0.25
8	合计	1,521,596,807.91	100.00

## 8.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	845,219,621.47	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,448,500.00	1.90
E	建筑业	169,350,434.85	11.70
F	批发和零售业	46,291,192.64	3.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	10,250,000.00	0.71
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,791,205.00	4.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	31,474,725.93	2.17
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	83,760,000.00	5.79
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	37,574,248.50	2.60
S	综合	22,316,670.60	1.54
	合计	1,335,476,598.99	92.28

### 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	002713	东易日盛	1,749,914	55,997,248.00	3.87
2	000625	长安汽车	2,999,954	50,909,219.38	3.52
3	002009	天奇股份	2,399,918	49,798,298.50	3.44
4	002347	泰尔重工	2,100,000	49,623,000.00	3.43
5	300190	维尔利	2,000,000	48,560,000.00	3.36
6	002216	三全食品	4,099,892	46,697,769.88	3.23
7	002456	欧菲光	1,300,000	40,326,000.00	2.79
8	000615	湖北金环	2,500,000	39,375,000.00	2.72
9	002361	神剑股份	2,399,812	39,020,943.12	2.70
10	000793	华闻传媒	2,499,950	37,574,248.50	2.60

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（www.ccfund.com.cn）的年度报告正文。

### 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	000625	长安汽车	133,501,813.78	59.25
2	002375	亚厦股份	107,400,720.81	47.66
3	300059	东方财富	101,415,699.98	45.01
4	002216	三全食品	100,346,220.20	44.53
5	002081	金螳螂	96,598,969.90	42.87
6	300049	福瑞股份	94,409,418.63	41.90
7	000839	中信国安	85,840,827.89	38.10
8	002009	天奇股份	84,839,890.70	37.65
9	601166	兴业银行	82,820,052.26	36.75
10	300063	天龙集团	82,589,662.89	36.65



11	300324	旋极信息	82,003,035.17	36.39
12	000666	经纬纺机	81,435,368.32	36.14
13	600446	金证股份	81,371,078.89	36.11
14	600687	刚泰控股	75,763,875.17	33.62
15	000402	金融街	71,785,155.67	31.86
16	600804	鹏博士	70,884,926.83	31.46
17	000899	赣能股份	67,889,847.11	30.13
18	600000	浦发银行	67,293,553.02	29.86
19	001696	宗申动力	65,179,680.92	28.93
20	002157	正邦科技	63,076,307.80	27.99
21	300135	宝利国际	61,971,043.11	27.50
22	300207	欣旺达	60,448,356.21	26.83
23	600485	信威集团	58,540,936.20	25.98
24	002228	合兴包装	58,034,920.22	25.76
25	600093	禾嘉股份	57,925,033.68	25.71
26	601211	国泰君安	57,902,268.67	25.70
27	002086	东方海洋	56,913,176.59	25.26
28	300226	上海钢联	55,595,138.50	24.67
29	601311	骆驼股份	53,520,012.45	23.75
30	600999	招商证券	52,085,514.13	23.12
31	002313	日海通讯	50,999,433.82	22.63
32	002321	华英农业	50,980,664.72	22.62
33	000615	湖北金环	50,770,851.57	22.53
34	002125	湘潭电化	50,367,023.44	22.35
35	002189	利达光电	50,236,313.99	22.29
36	000971	高升控股	49,097,242.60	21.79
37	002488	金固股份	48,909,135.62	21.71
38	002713	东易日盛	47,585,013.14	21.12
39	600271	航天信息	45,770,195.02	20.31
40	300190	维尔利	45,605,867.42	20.24
41	601169	北京银行	45,479,330.51	20.18
42	600483	福能股份	45,194,993.42	20.06
43	000568	泸州老窖	44,963,779.90	19.95
44	002183	怡亚通	44,584,151.20	19.79
45	000793	华闻传媒	44,287,159.79	19.65
46	000488	晨鸣纸业	44,098,125.88	19.57

47	002361	神剑股份	43,425,914.54	19.27
48	600703	三安光电	42,689,479.34	18.95
49	002113	天润控股	42,533,557.36	18.88
50	002661	克明面业	42,277,006.04	18.76
51	002482	广田股份	41,970,536.24	18.63
52	300252	金信诺	41,952,037.59	18.62
53	300125	易世达	41,229,350.70	18.30
54	000333	美的集团	40,130,254.59	17.81
55	600382	广东明珠	40,018,565.66	17.76
56	600476	湘邮科技	38,729,562.00	17.19
57	300295	三六五网	38,633,936.51	17.15
58	600030	中信证券	38,109,260.20	16.91
59	601688	华泰证券	38,013,043.69	16.87
60	002347	泰尔重工	36,352,074.17	16.13
61	600112	天成控股	36,177,975.23	16.06
62	002740	爱迪尔	36,044,348.10	16.00
63	600016	民生银行	35,796,002.00	15.89
64	601877	正泰电器	35,417,406.58	15.72
65	600563	法拉电子	34,558,142.33	15.34
66	000776	广发证券	34,323,680.52	15.23
67	300085	银之杰	34,272,815.35	15.21
68	603808	歌力思	34,163,294.68	15.16
69	000062	深圳华强	34,026,336.08	15.10
70	601313	江南嘉捷	33,935,851.52	15.06
71	002456	欧菲光	33,910,062.49	15.05
72	300103	达刚路机	33,667,082.85	14.94
73	002135	东南网架	33,477,677.20	14.86
74	600531	豫光金铅	32,936,255.19	14.62
75	000024	招商地产	32,341,988.44	14.35
76	600305	恒顺醋业	31,764,948.70	14.10
77	300200	高盟新材	31,285,022.86	13.88
78	000651	格力电器	31,089,362.26	13.80
79	002534	杭锅股份	30,860,958.06	13.70
80	002363	隆基机械	30,629,964.46	13.59
81	002283	天润曲轴	30,389,715.84	13.49
82	000902	新洋丰	30,343,274.69	13.47

83	000166	申万宏源	30,160,872.03	13.39
84	002033	丽江旅游	30,046,638.84	13.33
85	000926	福星股份	29,803,114.00	13.23
86	002345	潮宏基	29,545,624.53	13.11
87	601336	新华保险	29,054,523.57	12.89
88	000697	炼石有色	28,965,165.92	12.85
89	002318	久立特材	28,510,321.94	12.65
90	600603	大洲兴业	28,495,005.71	12.65
91	002104	恒宝股份	28,303,894.36	12.56
92	601886	江河创建	28,276,651.61	12.55
93	002674	兴业科技	28,262,387.12	12.54
94	000001	平安银行	27,966,913.31	12.41
95	600969	郴电国际	27,906,478.75	12.38
96	002576	通达动力	27,798,379.31	12.34
97	002671	龙泉股份	27,667,073.61	12.28
98	300322	硕贝德	27,515,080.38	12.21
99	000733	振华科技	27,213,646.47	12.08
100	603008	喜临门	27,194,761.15	12.07
101	600584	长电科技	26,932,735.87	11.95
102	002191	劲嘉股份	26,555,496.25	11.79
103	001979	招商蛇口	26,012,748.00	11.54
104	300099	尤洛卡	25,790,167.96	11.45
105	300198	纳川股份	25,287,943.28	11.22
106	600406	国电南瑞	25,248,205.33	11.20
107	600105	永鼎股份	25,144,315.56	11.16
108	300100	双林股份	24,803,289.66	11.01
109	002241	歌尔声学	24,701,742.87	10.96
110	002296	辉煌科技	24,590,156.40	10.91
111	600501	航天晨光	24,427,938.15	10.84
112	002516	旷达科技	24,056,409.67	10.68
113	601377	兴业证券	23,967,102.49	10.64
114	002284	亚太股份	23,913,436.93	10.61
115	000673	当代东方	23,793,379.50	10.56
116	002139	拓邦股份	23,768,240.76	10.55
117	000728	国元证券	23,560,291.77	10.46
118	600340	华夏幸福	23,501,278.52	10.43

119	300033	同花顺	23,231,878.00	10.31
120	002327	富安娜	23,156,472.75	10.28
121	600277	亿利能源	22,876,788.74	10.15
122	600171	上海贝岭	22,659,958.00	10.06
123	002348	高乐股份	22,238,782.06	9.87
124	000906	物产中拓	21,735,905.87	9.65
125	300210	森远股份	21,621,185.27	9.60
126	600883	博闻科技	21,593,104.71	9.58
127	300153	科泰电源	21,542,022.56	9.56
128	002606	大连电瓷	21,482,848.69	9.53
129	300142	沃森生物	21,278,195.31	9.44
130	600232	金鹰股份	20,833,579.59	9.25
131	600865	百大集团	20,731,806.90	9.20
132	300089	文化长城	20,703,494.73	9.19
133	300023	宝德股份	20,504,838.91	9.10
134	300217	东方电热	20,420,482.76	9.06
135	600837	海通证券	20,404,117.18	9.06
136	600327	大东方	20,298,004.93	9.01
137	600203	福日电子	20,214,820.24	8.97
138	600889	南京化纤	20,164,689.91	8.95
139	300331	苏大维格	20,030,985.76	8.89
140	000797	中国武夷	19,943,119.60	8.85
141	000002	万 科 A	19,830,862.62	8.80
142	002513	蓝丰生化	19,655,927.08	8.72
143	002567	唐人神	19,572,816.14	8.69
144	603898	好莱客	19,146,511.93	8.50
145	002396	星网锐捷	18,918,842.95	8.40
146	002448	中原内配	18,914,806.53	8.39
147	000078	海王生物	18,795,521.98	8.34
148	601555	东吴证券	18,737,279.64	8.32
149	600064	南京高科	18,687,523.32	8.29
150	300275	梅安森	18,512,892.01	8.22
151	300342	天银机电	18,405,749.00	8.17
152	002449	国星光电	18,233,396.86	8.09
153	000623	吉林敖东	18,220,727.89	8.09
154	300389	艾比森	18,172,997.08	8.07

155	600594	益佰制药	17,572,916.00	7.80
156	002374	丽鹏股份	17,255,298.50	7.66
157	600570	恒生电子	17,204,905.00	7.64
158	600480	凌云股份	17,018,397.31	7.55
159	300362	天保重装	16,701,572.00	7.41
160	600552	方兴科技	16,269,905.49	7.22
161	300008	上海佳豪	16,244,235.00	7.21
162	002594	比亚迪	16,172,371.00	7.18
163	002431	棕榈园林	16,125,699.31	7.16
164	600742	一汽富维	15,963,977.38	7.08
165	600685	广船国际	15,943,192.69	7.08
166	600048	保利地产	15,883,359.87	7.05
167	002637	赞宇科技	15,781,574.10	7.00
168	000975	银泰资源	15,406,338.66	6.84
169	002714	牧原股份	15,310,847.43	6.79
170	002650	加加食品	15,303,318.10	6.79
171	300072	三聚环保	15,154,632.96	6.73
172	300136	信维通信	14,816,475.44	6.58
173	603001	奥康国际	14,645,542.77	6.50
174	002736	国信证券	14,629,814.94	6.49
175	600358	国旅联合	14,540,048.94	6.45
176	600708	海博股份	14,447,026.51	6.41
177	000566	海南海药	14,284,000.00	6.34
178	600499	科达洁能	14,248,957.90	6.32
179	002574	明牌珠宝	14,197,336.00	6.30
180	600790	轻纺城	14,140,915.00	6.28
181	002316	键桥通讯	13,744,888.90	6.10
182	002477	雏鹰农牧	13,548,749.22	6.01
183	300195	长荣股份	13,541,083.82	6.01
184	300104	乐视网	13,510,247.00	6.00
185	300325	德威新材	13,442,639.80	5.97
186	300218	安利股份	13,441,475.07	5.97
187	600360	华微电子	13,187,601.00	5.85
188	000887	中鼎股份	13,018,015.20	5.78
189	300202	聚龙股份	13,009,910.30	5.77
190	002630	华西能源	12,716,814.27	5.64

191	002133	广宇集团	12,627,586.00	5.60
192	002214	大立科技	12,354,660.28	5.48
193	600057	象屿股份	12,314,622.14	5.47
194	600323	瀚蓝环境	12,110,935.47	5.37
195	002388	新亚制程	12,047,711.56	5.35
196	002236	大华股份	11,742,909.87	5.21
197	000058	深赛格	11,663,633.30	5.18
198	000401	冀东水泥	11,644,021.28	5.17
199	000985	大庆华科	11,589,813.48	5.14
200	600209	罗顿发展	11,536,206.42	5.12
201	002648	卫星石化	11,317,907.00	5.02
202	603989	艾华集团	11,257,483.00	5.00
203	002585	双星新材	11,211,267.04	4.98
204	002108	沧州明珠	11,000,072.39	4.88
205	002245	澳洋顺昌	10,835,936.79	4.81
206	600887	伊利股份	10,810,290.15	4.80
207	002715	登云股份	10,783,674.22	4.79
208	300284	苏交科	10,730,900.18	4.76
209	000988	华工科技	10,729,437.00	4.76
210	600551	时代出版	10,608,399.34	4.71
211	000550	江铃汽车	10,567,055.08	4.69
212	000428	华天酒店	10,551,107.47	4.68
213	300145	南方泵业	10,547,494.68	4.68
214	002273	水晶光电	10,485,611.71	4.65
215	300237	美晨科技	10,390,680.00	4.61
216	601328	交通银行	10,274,986.00	4.56
217	600350	山东高速	10,255,371.56	4.55
218	600103	青山纸业	10,239,494.25	4.54
219	300041	回天新材	10,235,254.65	4.54
220	600530	交大昂立	10,226,586.80	4.54
221	002584	西陇科学	10,211,503.33	4.53
222	300234	开尔新材	10,036,000.00	4.45
223	000639	西王食品	9,714,434.22	4.31
224	600705	中航资本	9,625,470.45	4.27
225	300071	华谊嘉信	9,514,257.93	4.22
226	300395	菲利华	9,382,369.63	4.16

227	601222	林洋电子	9,380,927.00	4.16
228	002695	煌上煌	9,179,507.71	4.07
229	300420	五洋科技	9,032,009.10	4.01
230	300196	长海股份	8,899,628.39	3.95
231	002521	齐峰新材	8,631,000.00	3.83
232	002358	森源电气	8,572,745.27	3.80
233	600596	新安股份	8,544,925.08	3.79
234	000060	中金岭南	8,539,266.56	3.79
235	002480	新筑股份	8,500,890.25	3.77
236	600109	国金证券	8,468,636.57	3.76
237	601258	庞大集团	8,452,567.00	3.75
238	601058	赛轮金宇	8,413,859.13	3.73
239	002609	捷顺科技	8,366,807.06	3.71
240	000513	丽珠集团	8,349,389.32	3.71
241	600104	上汽集团	8,289,289.50	3.68
242	600185	格力地产	8,224,631.89	3.65
243	600960	渤海活塞	8,121,941.00	3.60
244	002355	兴民钢圈	7,961,125.66	3.53
245	300214	日科化学	7,866,941.77	3.49
246	000059	*ST 华锦	7,696,529.96	3.42
247	601998	中信银行	7,670,000.00	3.40
248	600518	康美药业	7,557,520.00	3.35
249	002334	英威腾	7,452,992.61	3.31
250	600896	中海海盛	7,438,899.25	3.30
251	000952	广济药业	7,327,949.52	3.25
252	000096	广聚能源	6,906,695.00	3.07
253	300025	华星创业	6,891,309.40	3.06
254	600114	东睦股份	6,846,105.14	3.04
255	002436	兴森科技	6,840,000.00	3.04
256	000829	天音控股	6,817,634.80	3.03
257	002258	利尔化学	6,729,925.00	2.99
258	600015	华夏银行	6,675,702.00	2.96
259	600373	中文传媒	6,658,042.94	2.95
260	601318	中国平安	6,591,400.00	2.93
261	300157	恒泰艾普	6,572,794.92	2.92
262	000593	大通燃气	6,524,451.98	2.90

263	002047	宝鹰股份	6,481,833.49	2.88
264	002124	天邦股份	6,329,137.09	2.81
265	002185	华天科技	6,295,000.00	2.79
266	600886	国投电力	6,272,633.88	2.78
267	002547	春兴精工	6,248,849.23	2.77
268	002665	首航节能	6,029,500.00	2.68
269	600716	凤凰股份	5,877,711.42	2.61
270	002054	德美化工	5,712,936.20	2.54
271	000045	深纺织A	5,630,450.44	2.50
272	300253	卫宁软件	5,616,499.00	2.49
273	300032	金龙机电	5,219,954.00	2.32
274	002384	东山精密	5,044,492.32	2.24
275	300151	昌红科技	5,021,316.00	2.23
276	300263	隆华节能	4,875,000.00	2.16
277	002484	江海股份	4,862,015.68	2.16
278	002238	天威视讯	4,750,000.00	2.11
279	300368	汇金股份	4,697,000.00	2.08
280	601628	中国人寿	4,646,000.00	2.06
281	002156	通富微电	4,614,187.73	2.05

注：买入金额按买卖成交金额（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	000625	长安汽车	111,414,897.66	49.44
2	300063	天龙集团	101,548,312.12	45.07
3	601166	兴业银行	93,491,881.16	41.49
4	600687	刚泰控股	93,255,112.24	41.39
5	002081	金螳螂	84,262,743.32	37.40
6	300207	欣旺达	80,723,126.76	35.82
7	000666	经纬纺机	78,952,536.02	35.04
8	002157	正邦科技	78,832,234.72	34.99
9	000899	赣能股份	77,784,711.99	34.52
10	000402	金融街	76,517,616.32	33.96
11	600000	浦发银行	74,149,361.93	32.91
12	300324	旋极信息	73,151,334.83	32.46



13	600446	金证股份	71,356,399.38	31.67
14	300059	东方财富	68,082,347.16	30.21
15	001696	宗申动力	66,599,916.46	29.56
16	600483	福能股份	66,407,947.89	29.47
17	002216	三全食品	63,851,502.80	28.34
18	002482	广田股份	63,344,193.06	28.11
19	601211	国泰君安	60,976,223.31	27.06
20	002375	亚厦股份	58,687,232.37	26.04
21	600093	禾嘉股份	58,457,252.36	25.94
22	300049	福瑞股份	57,925,525.02	25.71
23	600999	招商证券	55,393,631.63	24.58
24	300252	金信诺	54,188,732.61	24.05
25	002321	华英农业	54,071,614.96	24.00
26	002313	日海通讯	53,675,283.64	23.82
27	002189	利达光电	53,289,221.73	23.65
28	600271	航天信息	52,701,463.01	23.39
29	000568	泸州老窖	51,575,417.17	22.89
30	601311	骆驼股份	51,411,918.82	22.82
31	600476	湘邮科技	49,412,150.97	21.93
32	002113	天润控股	48,933,131.46	21.72
33	002661	克明面业	46,362,408.77	20.58
34	300226	上海钢联	45,738,701.42	20.30
35	002086	东方海洋	45,472,753.60	20.18
36	300295	三六五网	45,135,148.15	20.03
37	600703	三安光电	45,090,835.30	20.01
38	000651	格力电器	45,050,877.76	19.99
39	600030	中信证券	44,593,486.92	19.79
40	000333	美的集团	43,871,376.54	19.47
41	300125	易世达	43,684,817.08	19.39
42	300103	达刚路机	43,665,991.59	19.38
43	600305	恒顺醋业	43,377,790.71	19.25
44	600531	豫光金铅	41,953,325.86	18.62
45	601169	北京银行	41,383,793.31	18.37
46	603008	喜临门	40,374,665.39	17.92
47	600112	天成控股	40,193,153.35	17.84
48	000776	广发证券	39,412,933.28	17.49
49	000839	中信国安	39,350,038.14	17.46
50	601688	华泰证券	38,533,544.54	17.10

51	603808	歌力思	38,269,057.17	16.98
52	600563	法拉电子	38,058,522.58	16.89
53	002183	怡亚通	37,540,494.13	16.66
54	002284	亚太股份	36,878,644.36	16.37
55	600016	民生银行	36,728,259.84	16.30
56	000062	深圳华强	36,711,374.19	16.29
57	002576	通达动力	36,238,643.39	16.08
58	601313	江南嘉捷	36,059,169.11	16.00
59	000902	新洋丰	35,427,837.59	15.72
60	600804	鹏博士	34,824,189.90	15.45
61	000166	申万宏源	34,764,549.03	15.43
62	002009	天奇股份	34,231,854.52	15.19
63	000697	炼石有色	34,165,255.96	15.16
64	002345	潮宏基	34,057,435.88	15.11
65	002740	爱迪尔	33,689,843.57	14.95
66	002283	天润曲轴	33,487,834.29	14.86
67	601886	江河创建	33,428,800.11	14.84
68	000733	振华科技	33,329,431.18	14.79
69	002363	隆基机械	33,145,963.65	14.71
70	000024	招商地产	33,043,677.61	14.66
71	300100	双林股份	31,499,149.26	13.98
72	601336	新华保险	31,392,574.52	13.93
73	600203	福日电子	31,252,137.75	13.87
74	002125	湘潭电化	30,549,934.58	13.56
75	000001	平安银行	30,236,750.63	13.42
76	300200	高盟新材	30,213,926.33	13.41
77	002488	金固股份	29,520,733.88	13.10
78	002241	歌尔声学	29,039,868.50	12.89
79	601377	兴业证券	28,668,021.73	12.72
80	600485	信威集团	27,659,370.90	12.27
81	600232	金鹰股份	27,113,202.48	12.03
82	600277	亿利能源	27,064,159.74	12.01
83	000728	国元证券	26,983,725.20	11.98
84	000488	晨鸣纸业	26,895,421.44	11.94
85	300089	文化长城	26,785,616.04	11.89
86	600594	益佰制药	26,659,760.82	11.83
87	000971	高升控股	26,500,717.21	11.76
88	600685	广船国际	26,491,608.28	11.76

89	300153	科泰电源	26,337,736.66	11.69
90	002516	旷达科技	25,430,429.91	11.29
91	002448	中原内配	25,011,440.73	11.10
92	300104	乐视网	25,002,209.45	11.10
93	300135	宝利国际	24,728,066.26	10.97
94	603898	好莱客	24,560,148.54	10.90
95	002606	大连电瓷	24,267,571.65	10.77
96	002449	国星光电	24,214,490.62	10.75
97	600340	华夏幸福	23,847,038.81	10.58
98	600883	博闻科技	23,842,170.74	10.58
99	300362	天保重装	23,809,642.00	10.57
100	300023	宝德股份	23,689,718.60	10.51
101	600171	上海贝岭	22,717,351.09	10.08
102	300033	同花顺	22,194,138.74	9.85
103	600105	永鼎股份	22,178,663.73	9.84
104	000673	当代东方	21,857,744.30	9.70
105	600865	百大集团	21,766,590.70	9.66
106	002396	星网锐捷	21,730,266.34	9.64
107	601555	东吴证券	21,638,890.81	9.60
108	002567	唐人神	21,452,397.68	9.52
109	300072	三聚环保	21,326,474.66	9.46
110	300275	梅安森	21,120,095.39	9.37
111	002327	富安娜	20,953,206.90	9.30
112	001979	招商蛇口	20,895,500.87	9.27
113	000002	万科A	20,652,132.50	9.17
114	002185	华天科技	20,621,891.69	9.15
115	600889	南京化纤	20,394,647.89	9.05
116	600064	南京高科	20,120,593.71	8.93
117	300142	沃森生物	20,060,590.19	8.90
118	300331	苏大维格	19,481,026.46	8.65
119	600327	大东方	19,324,238.95	8.58
120	300217	东方电热	18,944,614.95	8.41
121	600837	海通证券	18,873,381.69	8.38
122	600570	恒生电子	18,794,273.00	8.34
123	000887	中鼎股份	18,762,848.05	8.33
124	300032	金龙机电	18,696,607.82	8.30
125	002139	拓邦股份	18,400,026.05	8.17
126	600552	方兴科技	18,393,578.64	8.16

127	000623	吉林敖东	18,254,805.25	8.10
128	600742	一汽富维	18,089,271.26	8.03
129	603001	奥康国际	18,008,000.00	7.99
130	601877	正泰电器	17,932,643.00	7.96
131	600358	国旅联合	17,838,425.94	7.92
132	600048	保利地产	17,400,082.46	7.72
133	002674	兴业科技	16,932,179.80	7.51
134	300085	银之杰	16,862,426.09	7.48
135	002594	比亚迪	16,771,639.70	7.44
136	002714	牧原股份	16,715,661.44	7.42
137	300210	森远股份	16,616,581.31	7.37
138	300008	上海佳豪	16,544,816.62	7.34
139	002191	劲嘉股份	16,253,132.08	7.21
140	000797	中国武夷	16,245,027.59	7.21
141	002650	加加食品	16,243,837.00	7.21
142	002334	英威腾	16,179,333.40	7.18
143	000793	华闻传媒	16,031,356.88	7.11
144	000975	银泰资源	16,030,397.64	7.11
145	300195	长荣股份	15,936,286.10	7.07
146	600323	瀚蓝环境	15,934,128.70	7.07
147	002637	赞宇科技	15,890,620.84	7.05
148	002477	雏鹰农牧	15,813,961.57	7.02
149	300303	聚飞光电	15,799,358.50	7.01
150	601318	中国平安	15,786,955.00	7.01
151	300284	苏交科	15,754,976.64	6.99
152	000615	湖北金环	15,599,300.17	6.92
153	000566	海南海药	15,516,508.39	6.89
154	002574	明牌珠宝	15,333,855.35	6.81
155	300325	德威新材	15,264,442.32	6.77
156	600499	科达洁能	15,091,711.00	6.70
157	002736	国信证券	15,023,883.00	6.67
158	002665	首航节能	14,969,775.40	6.64
159	300218	安利股份	14,868,122.35	6.60
160	002388	新亚制程	14,850,518.80	6.59
161	300136	信维通信	14,679,199.08	6.51
162	002133	广宇集团	14,215,251.80	6.31
163	002316	键桥通讯	13,859,114.56	6.15
164	002236	大华股份	13,335,239.63	5.92

165	300234	开尔新材	13,276,824.75	5.89
166	002630	华西能源	13,266,286.93	5.89
167	300202	聚龙股份	13,133,742.52	5.83
168	002273	水晶光电	12,753,346.23	5.66
169	300237	美晨科技	12,730,048.20	5.65
170	600209	罗顿发展	12,628,791.49	5.60
171	600057	象屿股份	12,574,580.90	5.58
172	000078	海王生物	12,538,572.95	5.56
173	000058	深赛格	12,455,317.47	5.53
174	000985	大庆华科	12,255,550.95	5.44
175	002214	大立科技	12,253,960.52	5.44
176	000401	冀东水泥	12,247,724.95	5.44
177	002108	沧州明珠	12,242,798.29	5.43
178	603989	艾华集团	12,212,457.00	5.42
179	300395	菲利华	12,188,340.50	5.41
180	002648	卫星石化	11,889,955.00	5.28
181	000963	华东医药	11,561,360.33	5.13
182	002585	双星新材	11,538,563.50	5.12
183	002584	西陇科学	11,459,420.89	5.09
184	000988	华工科技	11,428,232.50	5.07
185	000639	西王食品	11,420,170.82	5.07
186	600350	山东高速	11,325,731.84	5.03
187	002521	齐峰新材	11,307,792.00	5.02
188	002245	澳洋顺昌	11,108,866.03	4.93
189	300420	五洋科技	11,015,814.10	4.89
190	600480	凌云股份	10,870,107.85	4.82
191	600584	长电科技	10,867,715.96	4.82
192	300041	回天新材	10,738,921.47	4.77
193	600551	时代出版	10,736,656.08	4.76
194	002715	登云股份	10,686,798.85	4.74
195	600790	轻纺城	10,556,109.00	4.68
196	002695	煌上煌	10,547,909.40	4.68
197	600382	广东明珠	10,546,759.98	4.68
198	300389	艾比森	10,481,241.61	4.65
199	601258	庞大集团	10,329,722.30	4.58
200	002358	森源电气	10,325,207.59	4.58
201	600850	华东电脑	10,312,030.32	4.58
202	000550	江铃汽车	10,301,968.28	4.57

203	300145	南方泵业	10,280,351.89	4.56
204	002124	天邦股份	9,897,089.87	4.39
205	600960	渤海活塞	9,889,742.00	4.39
206	600887	伊利股份	9,852,829.03	4.37
207	300196	长海股份	9,825,962.79	4.36
208	300071	华谊嘉信	9,794,707.43	4.35
209	002609	捷顺科技	9,774,711.00	4.34
210	600185	格力地产	9,736,507.09	4.32
211	601328	交通银行	9,431,934.50	4.19
212	600103	青山纸业	9,404,500.00	4.17
213	600518	康美药业	9,357,588.75	4.15
214	002355	兴民钢圈	9,320,502.06	4.14
215	000926	福星股份	9,168,753.00	4.07
216	600705	中航资本	9,094,127.00	4.04
217	000060	中金岭南	9,028,782.56	4.01
218	002436	兴森科技	8,869,560.00	3.94
219	000513	丽珠集团	8,822,411.80	3.92
220	300242	明家科技	8,787,481.28	3.90
221	600109	国金证券	8,755,191.06	3.89
222	600104	上汽集团	8,510,251.22	3.78
223	300047	天源迪科	8,339,605.20	3.70
224	600896	中海海盛	8,292,660.00	3.68
225	000952	广济药业	8,167,708.07	3.62
226	600015	华夏银行	8,089,657.48	3.59
227	601222	林洋电子	8,079,785.00	3.59
228	300214	日科化学	8,014,799.26	3.56
229	000059	*ST 华锦	7,988,674.00	3.55
230	600530	交大昂立	7,865,035.56	3.49
231	002480	新筑股份	7,853,378.00	3.49
232	601998	中信银行	7,780,000.00	3.45
233	000829	天音控股	7,778,193.00	3.45
234	300263	隆华节能	7,674,315.12	3.41
235	300025	华星创业	7,564,523.84	3.36
236	300157	恒泰艾普	7,389,089.76	3.28
237	600373	中文传媒	7,286,692.18	3.23
238	002047	宝鹰股份	7,224,056.86	3.21
239	002547	春兴精工	7,122,349.02	3.16
240	000096	广聚能源	6,864,233.69	3.05

241	000593	大通燃气	6,836,713.00	3.03
242	600114	东睦股份	6,795,823.49	3.02
243	002258	利尔化学	6,741,949.14	2.99
244	300253	卫宁软件	6,627,192.88	2.94
245	600716	凤凰股份	6,381,558.00	2.83
246	000045	深纺织 A	6,359,902.00	2.82
247	601058	赛轮金宇	6,354,039.66	2.82
248	002054	德美化工	6,281,491.20	2.79
249	600886	国投电力	6,133,629.96	2.72
250	300151	昌红科技	5,935,604.00	2.63
251	002104	恒宝股份	5,899,134.84	2.62
252	600596	新安股份	5,831,526.10	2.59
253	300370	安控科技	5,637,540.00	2.50
254	002348	高乐股份	5,562,201.02	2.47
255	300291	华录百纳	5,452,982.95	2.42
256	600741	华域汽车	5,370,067.87	2.38
257	002384	东山精密	5,367,106.34	2.38
258	002156	通富微电	5,329,541.68	2.37
259	002484	江海股份	5,188,235.82	2.30
260	601818	光大银行	5,148,000.00	2.28
261	002238	天威视讯	5,028,933.30	2.23
262	000722	湖南发展	4,993,098.00	2.22
263	002234	民和股份	4,894,549.50	2.17
264	300368	汇金股份	4,758,296.00	2.11
265	300066	三川股份	4,742,139.94	2.10
266	300241	瑞丰光电	4,678,576.45	2.08
267	601607	上海医药	4,558,644.00	2.02

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

#### 8.4.3 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	7,435,751,250.26
卖出股票收入（成交）总额	6,635,493,844.49

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 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

注：本基金本期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货，本期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与股指期货交易。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本报告期本基金投资的前十名证券除湖北金环发行主体外，其他证券的发行主体未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。

湖北金环股份有限公司（以下简称“湖北金环”或“公司”）于 2015 年 6 月 30 日发布“关于收到中国证券监督管理委员会湖北监管局《行政监管措施决定书》的公告”，公告称公司收到中国证券监督管理委员会湖北监管局对公司下达的行政监管措施决定书及抄送给公司关于对相关



人员行政监管措施的决定书，分别为《湖北证监局关于对湖北金环采取责令改正措施的决定》、《湖北证监局关于对李红采取出具警示函措施的决定》及《湖北证监局关于对雷生安采取出具警示函措施的决定》。相关内容主要是公司原第二大股东湖北化纤开发有限公司在 2012 年年末、2013 年年末、2014 年 6 月末占用公司资金 7026.86 万元、13242.4 万元、14857.84 万元。湖北证监局对相关人员和公司进行了相关的处罚，另外在 2015 年 11 月 24 日深圳证券交易所对相关当事人进行了通报批评。公司公告按湖北证监局要求认真组织公司股东、董事、监事、高级管理人员及相关人员学习相关法律法规知识，进一步完善相关内控制度建设和执行，坚决杜绝今后再发生类似违规行为。

本基金管理小组分析认为，湖北金环违规事项已经调查完毕，且该事件发生在湖北金环更换大股东之前。长期来看，湖北金环在新的控股股东入主之后是值得长期投资的公司，该行政处罚措施不影响公司的长期投资价值。本基金经理依据基金合同和本公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对湖北金环进行了投资。

#### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

#### 8.12.3 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	1,202,319.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,731.65
5	应收申购款	2,519,519.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,751,570.65

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
8,753	67,790.99	487,628,984.07	82.18%	105,745,549.97	17.82%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	154,034.21	0.0260%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2009 年 1 月 15 日 ) 基金份额总额	485,751,247.50
本报告期期初基金份额总额	174,429,440.03
本报告期基金总申购份额	971,143,825.46
减:本报告期基金总赎回份额	552,198,731.45
本报告期基金拆分变动份额 ( 份额减少以 "-" 填列 )	-
本报告期期末基金份额总额	593,374,534.04

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。自 2016 年 2 月 1 日起，卢盛春先生担任公司副总经理。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币肆万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	2,844,908,581.72	20.29%	2,596,925.92	20.12%	-
华西证券	1	2,255,535,590.51	16.09%	2,072,000.43	16.06%	-
东方证券	2	1,514,286,831.32	10.80%	1,399,202.28	10.84%	-
中金公司	1	1,248,904,223.85	8.91%	1,157,987.33	8.97%	-
长城证券	3	1,072,247,031.28	7.65%	976,175.55	7.56%	-
安信证券	1	798,249,215.96	5.69%	743,408.70	5.76%	-
海通证券	1	717,286,223.63	5.12%	653,924.24	5.07%	-
国信证券	2	713,066,445.58	5.09%	663,221.29	5.14%	-
兴业证券	1	655,812,160.90	4.68%	604,938.74	4.69%	-
招商证券	2	501,305,146.73	3.58%	466,865.41	3.62%	-
平安证券	2	471,743,386.92	3.37%	439,336.15	3.40%	-
长江证券	1	307,249,541.24	2.19%	279,720.85	2.17%	-
中信证券	1	273,183,151.29	1.95%	254,415.15	1.97%	-
申万宏源	1	210,914,090.11	1.50%	195,578.78	1.52%	-
瑞银证券	1	171,562,756.26	1.22%	156,191.47	1.21%	-
华泰证券	1	86,126,098.07	0.61%	80,209.49	0.62%	-
国金证券	2	80,264,764.23	0.57%	74,750.87	0.58%	-
宏信证券	1	57,658,618.67	0.41%	53,696.89	0.42%	-
民生证券	1	38,571,201.68	0.28%	35,921.25	0.28%	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
天源证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

报告期内共新增 2 个专用交易单元（招商证券新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 44 个交易单元。

## 2、专用席位的选择标准和程序

本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- （3）经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本基金本报告期末未有租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。