

# 华宝兴业服务优选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：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据本基金合同规定，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审计，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 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 华宝兴业服务优选混合型证券投资基金  |
| 基金简称       | 华宝服务优选混合           |
| 基金主代码      | 000124             |
| 交易代码       | 000124             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2013 年 6 月 27 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 | 1,869,347,722.30 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

## 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 把握服务相关行业的稳步成长，力争在长期内为基金份额持有人获取超额回报。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 投资策略   | 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。本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值，分享服务业快速发展所带来的行业高回报。本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。在法律法规许可的前提下，本基金可基于谨慎原则运用权证等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以提高投资效率，管理基金投资组合风险水平，以更好地实现本基金的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 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<br>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                  | 010-67595096         |
|         | 电子邮箱 | xxpl@fsfund.com               | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话  |      | 400-700-5588、<br>021-38924558 | 010—67595096         |
| 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<br>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<br>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           | 2014 年         | 2013 年 6 月 27 日 (基<br>金合同生效<br>日)-2013 年 12 月 31<br>日 |
|---------------|------------------|----------------|-------------------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 930,028,333.18   | 103,509,596.52 | 1,318,254.41                                          |
| 本期利润          | 1,058,424,004.28 | 80,673,733.16  | 47,890,493.14                                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 1.0339           | 0.1714         | 0.0391                                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 46.16%           | 16.18%         | 3.82%                                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 123.34%          | 11.02%         | 5.30%                                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末          | 2014 年末        | 2013 年末                                               |
| 期末可供分配利润      | 1,728,750,610.08 | 40,052,011.66  | 6,931,683.10                                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.9248           | 0.1692         | 0.0062                                                |
| 期末基金资产净值      | 4,459,468,807.81 | 276,789,181.37 | 1,172,925,342.59                                      |
| 期末基金份额净值      | 2.386            | 1.169          | 1.053                                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2015 年末          | 2014 年末        | 2013 年末                                               |
| 基金份额累计净值增长率   | 161.09%          | 16.90%         | 5.30%                                                 |

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天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（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与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           | 39.13%   | 2.63%       | 14.48%     | 1.39%         | 24.65%  | 1.24% |
| 过去六个月           | 0.72%    | 3.30%       | -11.83%    | 2.20%         | 12.55%  | 1.10% |
| 过去一年            | 123.34%  | 3.22%       | 19.70%     | 2.04%         | 103.64% | 1.18% |
| 自基金合同生效日起至<br>今 | 161.09%  | 2.32%       | 92.88%     | 1.49%         | 68.21%  | 0.83% |

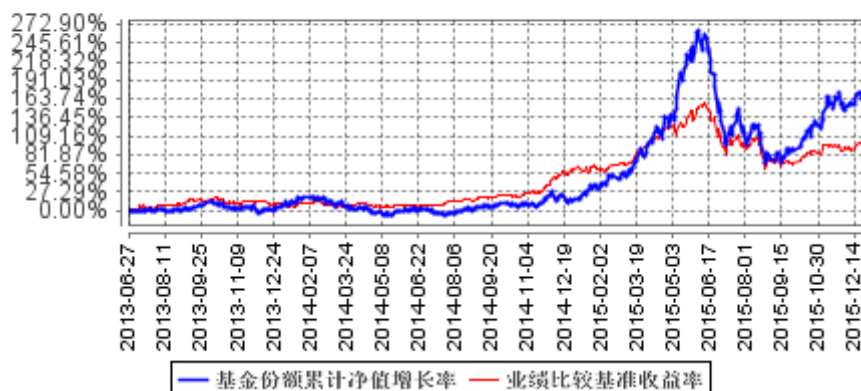
注：1、本基金业绩比较基准为：中证服务业指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，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

（2013年6月27日至2015年12月31日）

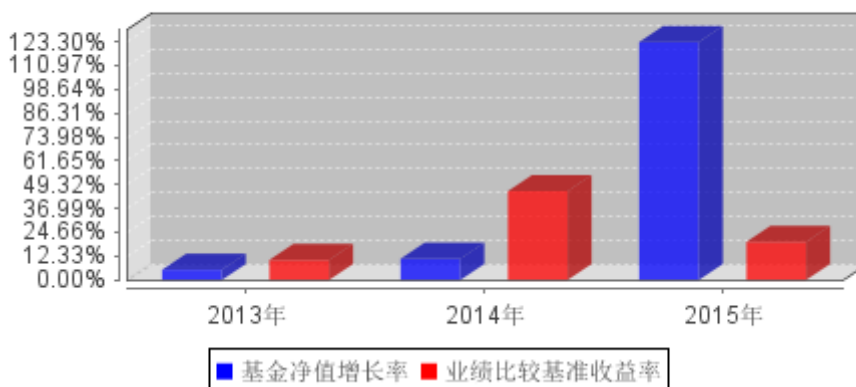
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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 2013 年 12 月 27 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

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对比图



注：本基金基金合同生效于 2013 年 6 月 27 日，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

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 | 3.0000        | 291,237,956.55 | 101,271,763.88 | 392,509,720.43 |    |
| 2014 | -             | -              | -              | -              |    |
| 2013 | -             | -              | -              | -              |    |
| 合计   | 3.0000        | 291,237,956.55 | 101,271,763.88 | 392,509,720.43 |    |

## § 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

基金管理人是在 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            |        |                                                                                                                                        |
| 楼鸿强 | 本基金基金经理、华宝万物互联混合基金经理                   | 2014 年 10 月 22 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。 |
| 邵喆阳 | 助理投资总监、本基金基金经理、华宝兴业收益增长混合、华宝生态中国混合基金经理 | 2013 年 6 月 27 日  | 2015 年 2 月 17 日 | 9 年    | 硕士，拥有 CFA 资格。曾任安永会计师事务所审计员。2006 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任行业分析师、基金经理助理、国内投资部副总经理的职务。2010 年 6 月至 2015 年 2 月任                               |

|     |                          |                |   |     |                                                                                                                          |
|-----|--------------------------|----------------|---|-----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                          |                |   |     | 华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理，2013 年 6 月至 2015 年 2 月任华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金经理，2014 年 6 月至 2015 年 2 月任助理投资总监，兼任华宝兴生态中国混合型证券投资基金基金经理。 |
| 代云锋 | 本基金基金经理助理、华宝稳健回报混合基金经理助理 | 2015 年 7 月 1 日 | - | 3 年 | 硕士。2012 年加入华宝兴业基金管理有限公司，先后担任研究部分析师、分析师的职务。2015 年 7 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助理，兼任华宝兴业稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。            |

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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合规守信情况的说明

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、《华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，服务优选混合型证券投资基金出现过持有单个股票占基金资产净值比超过 10%的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。



由于股、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，服务优选混合型证券投资基金出现过持有单个股票占基金资产净值比超过 10%的情况，且由于该股票停牌原因不能及时卖出。发生此类情况后，基金管理人持续关注该股票复牌情况，已在股票复牌后的合理期限内调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

### 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

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收

益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

2015 年全年基金管理人严格遵守公司内部制定的公平交易制度和控制方法，确保了所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。公司内部制定的公平交易制度涉及的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，分析了公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异；并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日、3 日、5 日）同向交易的样本，对其进行 95%置信区间下的假设检验分析，同时结合各组合的成交金额，并参考市场成交量等因素综合判断是否存在不公平交易、利益输送的可能。分析结果未发现异常情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，我司服务优选基金与事件驱动基金于 6 月 11 日对股票——尚荣医疗（002551）发生同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日市场成交量的 5%。发生反向交易的原因是由于该两只基金投资策略不同，且事件驱动基金处于建仓期进行买入，服务优选为实现收益卖出。两只基金操作行为均符合相关法律法规和基金契约的规定，同时符合我司内部公平交易和异常交易相关的制度，不涉及利益输送行为。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

## 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 年市场历经一轮波澜壮阔的牛市和相对剧烈的调整，对大部分市场参与者而言，既是收益较好的年份，也是风险教育的真实一课。

本基金上半年始终保持较高的仓位和弹性，积极布局互联网、精准医疗、高端装备、国企改革等板块，获得较好的收益。3 季度配置较为均衡，防御等待机会，并在 3 季度末较为迅速地高仓位参与反弹，4 季度也获得了较好的收益。整体上，本基金 2015 年采取了相对积极的策略，整体收益较好。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为 123.34%，同期业绩比较基准收益率为 19.70%，基金表现领先业绩比较基准 103.64%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，我们认为国内宏观经济较大幅度改善的难度较大，经济增长率仍在下台阶过程中，全社会经济要素和杠杆率并未实现较为健康的调整，经济转型和效率提升仍是一个中长期过程。此外，随着全球化进程的基本完成，全球经济金融的联动程度正不断提高，较为复杂的国内外经济形势和人民币汇率波动等问题，有可能制约国内经济转型的进程和相关政策的空间。

2015 年 A 股市场整体表现较好，大部分新兴行业个股的股价和估值仍处于相对较高的位置，需要时间消化。传统行业的机会仍受制于宏观改善的程度，有待观察。如前所述，全球经济及相关政策的联动性在加大，这也增加了市场运行的复杂度。此外，注册制等市场新政策仍需关注。

但是，挑战总是伴随着机遇。相信在全社会的共同努力下，中国经济转型的前景值得看好，也必将诞生一批优秀的公司。整体上，行情结构分化仍是市场趋势，真正优质的行业和公司将为投资者创造中长期的投资价值。

2016 年我们会继续以如履薄冰、如临深渊的谨慎态度和勤勉尽职的工作来回报投资者的支持与信任。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。

要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2015 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，不断加强了防控内幕交易等行为的稽核力度；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值过程中，公司内部参与估值流程的各方职责分工如下：

（一）、基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）、量化投资部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，根据估值委员会对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并在估值时兼顾考虑行业研究员提供的根据上市公司估值模型计算的结果所提出的建议或意见。

（三）、估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）、必要时基金经理就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规及基金合同的规定，本基金于 2015 年 5 月 28 日发布了分红公告，本次分红为 2015 年度的第 1 次分红。本基金向 2015 年 6 月 2 日在本基金注册登记机构登记在册的基金份额

持有人按每 10 份基金份额派发红利 3.00 元，利润分配合计为人民币 392,509,720.43 元，其中现金形式发放总额为人民币 291,237,956.55 元，再投资形式发放总额为人民币 101,271,763.88 元。

#### **4.9 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

### **§ 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，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 392,509,720.43 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**

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，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：华宝兴业服务优选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<br>2015 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            |            | 485,441,184.86                  | 43,686,958.46                    |
| 结算备付金           |            | 60,824,977.42                   | 3,611,801.86                     |
| 存出保证金           |            | 7,081,616.89                    | 216,491.85                       |
| 交易性金融资产         |            | 3,879,828,277.93                | 249,023,145.04                   |
| 其中：股票投资         |            | 3,879,828,277.93                | 249,023,145.04                   |
| 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         |            | 91,174,476.26                   | -                                |
| 应收利息            |            | 144,888.31                      | 9,993.03                         |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 33,395,046.75                   | 424,283.48                       |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            |            | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 4,557,890,468.42                | 296,972,673.72                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>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         |            | 5,016,282.01                    | 14,060,564.97                    |
| 应付赎回款           |            | 34,345,601.12                   | 2,051,058.67                     |
| 应付管理人报酬         |            | 5,471,162.60                    | 362,266.76                       |
| 应付托管费           |            | 911,860.41                      | 60,377.79                        |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          |            | 52,236,834.49                   | 3,065,525.20                     |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |

|               |  |                  |                |
|---------------|--|------------------|----------------|
| 应付利息          |  | -                | -              |
| 应付利润          |  | -                | -              |
| 递延所得税负债       |  | -                | -              |
| 其他负债          |  | 439,919.98       | 583,698.96     |
| 负债合计          |  | 98,421,660.61    | 20,183,492.35  |
| <b>所有者权益：</b> |  |                  |                |
| 实收基金          |  | 1,869,347,722.30 | 236,737,169.71 |
| 未分配利润         |  | 2,590,121,085.51 | 40,052,011.66  |
| 所有者权益合计       |  | 4,459,468,807.81 | 276,789,181.37 |
| 负债和所有者权益总计    |  | 4,557,890,468.42 | 296,972,673.72 |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.386 元，基金份额总额 1,869,347,722.30 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业服务优选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<br>2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>            |     | 1,246,354,774.92                    | 96,676,227.38                       |
| 1. 利息收入                |     | 2,931,875.82                        | 640,422.72                          |
| 其中：存款利息收入              |     | 2,931,875.82                        | 607,429.90                          |
| 债券利息收入                 |     | -                                   | 42.81                               |
| 资产支持证券利息收入             |     | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入             |     | -                                   | 32,950.01                           |
| 其他利息收入                 |     | -                                   | -                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |     | 1,083,088,031.13                    | 115,466,715.78                      |
| 其中：股票投资收益              |     | 1,078,027,432.40                    | 113,872,551.63                      |
| 基金投资收益                 |     | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                 |     | -                                   | 160,865.96                          |
| 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                   |     | 5,060,598.73                        | 1,433,298.19                        |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） |     | 128,395,671.10                      | -22,835,863.36                      |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |     | -                                   | -                                   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     |     | 31,939,196.87                       | 3,404,952.24                        |
| <b>减：二、费用</b>          |     | 187,930,770.64                      | 16,002,494.22                       |
| 1. 管理人报酬               |     | 33,513,204.23                       | 7,575,663.50                        |

|                            |  |                         |                      |
|----------------------------|--|-------------------------|----------------------|
| 2. 托管费                     |  | 5,585,533.92            | 1,262,610.62         |
| 3. 销售服务费                   |  | -                       | -                    |
| 4. 交易费用                    |  | 148,429,341.56          | 6,729,942.28         |
| 5. 利息支出                    |  | -                       | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |  | -                       | -                    |
| 6. 其他费用                    |  | 402,690.93              | 434,277.82           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |  | <b>1,058,424,004.28</b> | <b>80,673,733.16</b> |
| 减：所得税费用                    |  | -                       | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |  | <b>1,058,424,004.28</b> | <b>80,673,733.16</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业服务优选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<br>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）                        | 236,737,169.71                              | 40,052,011.66     | 276,789,181.37    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                           | 1,058,424,004.28  | 1,058,424,004.28  |
| 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）      | 1,632,610,552.59                            | 1,884,154,790.00  | 3,516,765,342.59  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 4,347,635,361.83                            | 5,373,090,227.51  | 9,720,725,589.34  |
| 2. 基金赎回款                               | -2,715,024,809.24                           | -3,488,935,437.51 | -6,203,960,246.75 |
| 四、本期向基金份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） | -                                           | -392,509,720.43   | -392,509,720.43   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,869,347,722.30                            | 2,590,121,085.51  | 4,459,468,807.81  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 |                   |                   |





根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华宝兴业服务优选股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业服务优选混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业服务优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、资产支持证券、权证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，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于服务相关行业股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金资产支持证券投资市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金权证投资市值不得超过基金资产净值的 3%；其余资产投资于现金、货币市场工具、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$ 中证服务业指数收益率 $+20\% \times$ 上证国债指数收益率。

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。

#### 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》、各项具体会计准则及其他相关规定（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（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》、《华宝兴业服务优选混合型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 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。

#### 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、买入返售金融资产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按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分红除权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，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润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。

经宣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

根据本基金的估值原则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，包括买卖股票的差价收入，股权的股息、红利收入，及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

#### 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                    | 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管理费  | 33,513,204.23         | 7,575,663.50          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 9,058,641.23          | 2,023,791.57          |

注：支付基金管理人 华宝兴业 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

##### 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 | 5,585,533.92          | 1,262,610.62          |



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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

### 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 |
| 期初持有的基金份额         | 250,156.90            | 250,156.90            |
| 期间申购/买入总份额        | 195,261.51            | -                     |
| 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         | 445,418.41            | 250,156.90            |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.02%                 | 0.11%                 |

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

份额单位：份

| 关联方名称    | 本期末           |                  | 上年度末          |                  |
|----------|---------------|------------------|---------------|------------------|
|          | 2015年12月31日   |                  | 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 |
| 华宝投资有限公司 | 14,064,228.78 | 0.75%            | 16,050,561.79 | 6.78%            |

### 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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |              | 上年度可比期间<br>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 | 485,441,184.86                         | 2,281,920.26 | 43,686,958.46                               | 575,751.98 |

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

本基金本报告期及上年度可比较期均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

本基金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 |
|--------|------|------------------|--------|--------|-----------------|--------|-----------|----------------|----------------|----|
| 002612 | 朗姿股份 | 2015 年 12 月 22 日 | 重大事项停牌 | 75.46  |                 |        | 2,571,342 | 147,296,781.20 | 194,033,467.32 | -  |
| 300038 | 梅泰诺  | 2015 年 12 月 16 日 | 重大事项停牌 | 56.68  |                 |        | 3,051,728 | 139,117,706.59 | 172,971,943.04 | -  |
| 300222 | 科大智能 | 2015 年 8 月 21 日  | 重大事项停牌 | 20.84  | 2016 年 1 月 7 日  | 21.16  | 2,675,605 | 55,081,633.48  | 55,759,608.20  | -  |
| 002502 | 骅威股份 | 2015 年 8 月 20 日  | 重大事项停牌 | 32.02  | 2016 年 1 月 14 日 | 23.35  | 1,446,560 | 41,232,503.41  | 46,318,851.20  | -  |
| 300324 | 旋极信息 | 2015 年 12 月 1 日  | 重大事项停牌 | 49.25  | 2016 年 3 月 10 日 | 44.33  | 886,625   | 39,292,305.82  | 43,666,281.25  | -  |

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

本基金本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 3,367,078,126.92 元，属于第二层次的余额为 512,750,151.01 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 191,100,122.80 元，第二层次 57,923,022.24 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，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(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。

(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              | 3,879,828,277.93 | 85.12         |
|    | 其中：股票             | 3,879,828,277.93 | 85.12         |
| 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      | 546,266,162.28   | 11.99         |
| 7  | 其他各项资产            | 131,796,028.21   | 2.89          |
| 8  | 合计                | 4,557,890,468.42 | 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         | 46,382,591.19    | 1.04          |
| B  | 采矿业              | -                | -             |
| C  | 制造业              | 2,302,967,300.30 | 51.64         |
| 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          | 97,634,604.00    | 2.19  |
| 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 | 932,919,587.50   | 20.92 |
| J | 金融业             | -                | -     |
| K | 房地产业            | 143,888,744.71   | 3.23  |
| L | 租赁和商务服务业        | -                | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | 112,634,591.70   | 2.53  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 1,316,431.28     | 0.03  |
| 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       | 242,084,427.25   | 5.43  |
| S | 综合              | -                | -     |
|   | 合计              | 3,879,828,277.93 | 87.00 |

### 8.2.2 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。

### 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  | 002188 | 新嘉联  | 6,250,326 | 277,826,990.70 | 6.23         |
| 2  | 300248 | 新开普  | 5,781,221 | 214,772,360.15 | 4.82         |
| 3  | 002612 | 朗姿股份 | 2,571,342 | 194,033,467.32 | 4.35         |
| 4  | 300230 | 永利带业 | 5,136,963 | 191,968,307.31 | 4.30         |
| 5  | 300038 | 梅泰诺  | 3,051,728 | 172,971,943.04 | 3.88         |
| 6  | 000802 | 北京文化 | 3,568,116 | 120,887,770.08 | 2.71         |
| 7  | 002260 | 德奥通航 | 2,401,126 | 108,530,895.20 | 2.43         |
| 8  | 000078 | 海王生物 | 4,074,900 | 97,634,604.00  | 2.19         |
| 9  | 300352 | 北信源  | 1,491,645 | 93,078,648.00  | 2.09         |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 10 | 300384 | 三联虹普 | 1,075,061 | 90,520,136.20 | 2.03 |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|

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](http://www.fsfund.com) 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  | 002657 | 中科金财 | 994,161,239.83 | 359.18         |
| 2  | 300244 | 迪安诊断 | 852,912,937.14 | 308.15         |
| 3  | 300347 | 泰格医药 | 828,814,463.55 | 299.44         |
| 4  | 300075 | 数字政通 | 789,618,461.86 | 285.28         |
| 5  | 300248 | 新开普  | 707,297,795.92 | 255.54         |
| 6  | 300253 | 卫宁软件 | 608,660,588.38 | 219.90         |
| 7  | 300222 | 科大智能 | 589,157,696.75 | 212.85         |
| 8  | 600446 | 金证股份 | 512,186,070.36 | 185.05         |
| 9  | 300033 | 同花顺  | 500,370,904.36 | 180.78         |
| 10 | 000547 | 航天发展 | 497,276,031.33 | 179.66         |
| 11 | 300018 | 中元华电 | 444,453,257.61 | 160.57         |
| 12 | 300049 | 福瑞股份 | 439,951,474.36 | 158.95         |
| 13 | 002642 | 荣之联  | 437,473,802.86 | 158.05         |
| 14 | 300295 | 三六五网 | 432,689,436.96 | 156.32         |
| 15 | 300231 | 银信科技 | 427,153,440.10 | 154.32         |
| 16 | 300364 | 中文在线 | 425,544,997.15 | 153.74         |
| 17 | 002373 | 千方科技 | 393,030,272.99 | 142.00         |
| 18 | 300252 | 金信诺  | 392,079,421.88 | 141.65         |
| 19 | 600570 | 恒生电子 | 385,380,224.33 | 139.23         |
| 20 | 300016 | 北陆药业 | 374,112,573.11 | 135.16         |
| 21 | 002308 | 威创股份 | 351,408,786.58 | 126.96         |
| 22 | 300400 | 劲拓股份 | 343,412,138.38 | 124.07         |
| 23 | 603766 | 隆鑫通用 | 341,072,561.63 | 123.22         |
| 24 | 002462 | 嘉事堂  | 334,895,516.28 | 120.99         |
| 25 | 300130 | 新国都  | 321,943,315.03 | 116.31         |
| 26 | 000858 | 五粮液  | 306,564,015.82 | 110.76         |

|    |        |      |                |        |
|----|--------|------|----------------|--------|
| 27 | 600820 | 隧道股份 | 305,352,765.91 | 110.32 |
| 28 | 300165 | 天瑞仪器 | 287,742,825.96 | 103.96 |
| 29 | 603636 | 南威软件 | 283,624,285.80 | 102.47 |
| 30 | 600571 | 信雅达  | 282,755,627.91 | 102.16 |
| 31 | 300178 | 腾邦国际 | 277,592,959.84 | 100.29 |
| 32 | 300254 | 仟源医药 | 272,306,377.82 | 98.38  |
| 33 | 300059 | 东方财富 | 271,076,057.78 | 97.94  |
| 34 | 300409 | 道氏技术 | 263,885,213.09 | 95.34  |
| 35 | 300010 | 立思辰  | 255,676,293.70 | 92.37  |
| 36 | 002074 | 国轩高科 | 254,667,741.73 | 92.01  |
| 37 | 600587 | 新华医疗 | 253,491,868.16 | 91.58  |
| 38 | 300038 | 梅泰诺  | 250,476,312.54 | 90.49  |
| 39 | 300226 | 上海钢联 | 249,276,748.83 | 90.06  |
| 40 | 002022 | 科华生物 | 248,248,067.05 | 89.69  |
| 41 | 000802 | 北京文化 | 245,583,074.03 | 88.73  |
| 42 | 002188 | 新嘉联  | 243,430,044.47 | 87.95  |
| 43 | 002381 | 双箭股份 | 240,414,377.98 | 86.86  |
| 44 | 300377 | 赢时胜  | 238,353,107.07 | 86.11  |
| 45 | 600391 | 成发科技 | 233,211,690.59 | 84.26  |
| 46 | 300140 | 启源装备 | 231,356,272.32 | 83.59  |
| 47 | 300352 | 北信源  | 230,557,304.61 | 83.30  |
| 48 | 600834 | 申通地铁 | 228,897,741.08 | 82.70  |
| 49 | 002260 | 德奥通航 | 226,280,261.34 | 81.75  |
| 50 | 600655 | 豫园商城 | 220,556,628.22 | 79.68  |
| 51 | 000158 | 常山股份 | 217,208,252.96 | 78.47  |
| 52 | 300439 | 美康生物 | 216,999,167.20 | 78.40  |
| 53 | 300468 | 四方精创 | 216,488,230.80 | 78.21  |
| 54 | 600827 | 百联股份 | 215,600,705.28 | 77.89  |
| 55 | 300022 | 吉峰农机 | 213,008,075.25 | 76.96  |
| 56 | 300440 | 运达科技 | 211,676,720.68 | 76.48  |
| 57 | 300144 | 宋城演艺 | 209,134,175.64 | 75.56  |
| 58 | 002466 | 天齐锂业 | 207,846,461.16 | 75.09  |
| 59 | 002472 | 双环传动 | 207,016,536.16 | 74.79  |
| 60 | 002747 | 埃斯顿  | 206,900,329.70 | 74.75  |
| 61 | 601021 | 春秋航空 | 205,565,139.88 | 74.27  |
| 62 | 002460 | 赣锋锂业 | 199,923,979.05 | 72.23  |

|    |        |      |                |       |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 63 | 600677 | 航天通信 | 199,327,698.54 | 72.01 |
| 64 | 300378 | 鼎捷软件 | 196,144,027.53 | 70.86 |
| 65 | 002060 | 粤水电  | 194,311,266.88 | 70.20 |
| 66 | 601555 | 东吴证券 | 193,233,562.65 | 69.81 |
| 67 | 300166 | 东方国信 | 192,620,795.79 | 69.59 |
| 68 | 300447 | 全信股份 | 192,090,514.50 | 69.40 |
| 69 | 300151 | 昌红科技 | 191,087,632.72 | 69.04 |
| 70 | 601166 | 兴业银行 | 190,465,049.14 | 68.81 |
| 71 | 300230 | 永利股份 | 187,614,221.13 | 67.78 |
| 72 | 002714 | 牧原股份 | 187,404,194.93 | 67.71 |
| 73 | 300398 | 飞凯材料 | 186,504,118.62 | 67.38 |
| 74 | 300404 | 博济医药 | 186,480,890.48 | 67.37 |
| 75 | 300113 | 顺网科技 | 184,709,505.74 | 66.73 |
| 76 | 600895 | 张江高科 | 183,159,650.86 | 66.17 |
| 77 | 300380 | 安硕信息 | 179,434,867.54 | 64.83 |
| 78 | 002589 | 瑞康医药 | 177,879,354.65 | 64.27 |
| 79 | 300379 | 东方通  | 175,903,011.23 | 63.55 |
| 80 | 600663 | 陆家嘴  | 174,636,855.29 | 63.09 |
| 81 | 300413 | 快乐购  | 174,284,618.26 | 62.97 |
| 82 | 300012 | 华测检测 | 168,284,832.54 | 60.80 |
| 83 | 600990 | 四创电子 | 165,584,159.00 | 59.82 |
| 84 | 600410 | 华胜天成 | 165,031,099.44 | 59.62 |
| 85 | 002551 | 尚荣医疗 | 163,200,083.82 | 58.96 |
| 86 | 300155 | 安居宝  | 163,122,884.79 | 58.93 |
| 87 | 600029 | 南方航空 | 160,584,805.60 | 58.02 |
| 88 | 300009 | 安科生物 | 159,581,444.05 | 57.65 |
| 89 | 002477 | 雏鹰农牧 | 157,833,726.98 | 57.02 |
| 90 | 002205 | 国统股份 | 157,270,648.68 | 56.82 |
| 91 | 300392 | 腾信股份 | 153,971,797.49 | 55.63 |
| 92 | 601988 | 中国银行 | 151,934,263.14 | 54.89 |
| 93 | 300147 | 香雪制药 | 150,434,869.86 | 54.35 |
| 94 | 601288 | 农业银行 | 149,751,297.28 | 54.10 |
| 95 | 300442 | 普丽盛  | 148,675,508.09 | 53.71 |
| 96 | 601377 | 兴业证券 | 148,300,083.07 | 53.58 |
| 97 | 002612 | 朗姿股份 | 147,296,781.20 | 53.22 |
| 98 | 600009 | 上海机场 | 147,224,765.73 | 53.19 |



|     |        |      |                |       |
|-----|--------|------|----------------|-------|
| 99  | 600172 | 黄河旋风 | 146,917,416.22 | 53.08 |
| 100 | 002594 | 比亚迪  | 145,420,741.68 | 52.54 |
| 101 | 300356 | 光一科技 | 142,964,743.14 | 51.65 |
| 102 | 600138 | 中青旅  | 141,345,894.71 | 51.07 |
| 103 | 000568 | 泸州老窖 | 140,747,081.63 | 50.85 |
| 104 | 300251 | 光线传媒 | 140,314,931.40 | 50.69 |
| 105 | 600038 | 中直股份 | 139,353,265.03 | 50.35 |
| 106 | 300186 | 大华农  | 138,778,202.16 | 50.14 |
| 107 | 300171 | 东富龙  | 136,723,747.02 | 49.40 |
| 108 | 300003 | 乐普医疗 | 135,974,046.83 | 49.13 |
| 109 | 002279 | 久其软件 | 134,358,279.39 | 48.54 |
| 110 | 002363 | 隆基机械 | 134,121,959.58 | 48.46 |
| 111 | 600749 | 西藏旅游 | 133,954,995.40 | 48.40 |
| 112 | 600109 | 国金证券 | 133,506,523.61 | 48.23 |
| 113 | 002332 | 仙琚制药 | 131,119,576.08 | 47.37 |
| 114 | 300367 | 东方网力 | 131,075,649.62 | 47.36 |
| 115 | 300397 | 天和防务 | 130,948,213.22 | 47.31 |
| 116 | 002184 | 海得控制 | 130,229,321.13 | 47.05 |
| 117 | 300238 | 冠昊生物 | 129,895,215.64 | 46.93 |
| 118 | 300131 | 英唐智控 | 128,230,050.04 | 46.33 |
| 119 | 300336 | 新文化  | 125,347,768.84 | 45.29 |
| 120 | 300399 | 京天利  | 125,115,847.27 | 45.20 |
| 121 | 002609 | 捷顺科技 | 124,025,366.14 | 44.81 |
| 122 | 002344 | 海宁皮城 | 123,883,589.51 | 44.76 |
| 123 | 300223 | 北京君正 | 122,136,762.08 | 44.13 |
| 124 | 002436 | 兴森科技 | 121,842,528.71 | 44.02 |
| 125 | 600115 | 东方航空 | 121,427,129.33 | 43.87 |
| 126 | 002108 | 沧州明珠 | 120,468,408.75 | 43.52 |
| 127 | 601318 | 中国平安 | 116,036,877.41 | 41.92 |
| 128 | 600292 | 中电远达 | 115,767,347.84 | 41.83 |
| 129 | 601211 | 国泰君安 | 113,433,315.90 | 40.98 |
| 130 | 002425 | 凯撒股份 | 112,619,241.50 | 40.69 |
| 131 | 600513 | 联环药业 | 112,171,483.44 | 40.53 |
| 132 | 002372 | 伟星新材 | 110,883,132.66 | 40.06 |
| 133 | 002445 | 中南重工 | 110,663,763.17 | 39.98 |
| 134 | 002518 | 科士达  | 110,600,525.23 | 39.96 |

|     |        |      |                |       |
|-----|--------|------|----------------|-------|
| 135 | 300219 | 鸿利光电 | 110,320,150.35 | 39.86 |
| 136 | 600879 | 航天电子 | 106,643,330.61 | 38.53 |
| 137 | 600701 | 工大高新 | 106,009,480.18 | 38.30 |
| 138 | 603019 | 中科曙光 | 105,154,023.07 | 37.99 |
| 139 | 002026 | 山东威达 | 104,427,489.61 | 37.73 |
| 140 | 600645 | 中源协和 | 103,926,322.17 | 37.55 |
| 141 | 002715 | 登云股份 | 103,469,486.08 | 37.38 |
| 142 | 601398 | 工商银行 | 103,359,931.69 | 37.34 |
| 143 | 002329 | 皇氏集团 | 102,842,326.61 | 37.16 |
| 144 | 600276 | 恒瑞医药 | 101,946,098.17 | 36.83 |
| 145 | 002290 | 禾盛新材 | 101,338,467.89 | 36.61 |
| 146 | 000906 | 物产中拓 | 100,879,004.43 | 36.45 |
| 147 | 300133 | 华策影视 | 100,775,893.91 | 36.41 |
| 148 | 300198 | 纳川股份 | 99,601,445.78  | 35.98 |
| 149 | 300051 | 三五互联 | 99,225,937.08  | 35.85 |
| 150 | 600343 | 航天动力 | 98,603,220.72  | 35.62 |
| 151 | 300384 | 三联虹普 | 98,103,364.11  | 35.44 |
| 152 | 300250 | 初灵信息 | 97,311,623.01  | 35.16 |
| 153 | 600622 | 嘉宝集团 | 97,191,749.26  | 35.11 |
| 154 | 002664 | 信质电机 | 97,156,116.97  | 35.10 |
| 155 | 002072 | 凯瑞德  | 96,712,014.98  | 34.94 |
| 156 | 002025 | 航天电器 | 96,150,141.17  | 34.74 |
| 157 | 002746 | 仙坛股份 | 95,847,006.66  | 34.63 |
| 158 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 93,241,850.37  | 33.69 |
| 159 | 300369 | 绿盟科技 | 93,170,368.49  | 33.66 |
| 160 | 002457 | 青龙管业 | 92,896,242.10  | 33.56 |
| 161 | 002711 | 欧浦智网 | 92,571,395.36  | 33.44 |
| 162 | 002299 | 圣农发展 | 92,481,506.91  | 33.41 |
| 163 | 000673 | 当代东方 | 91,801,526.46  | 33.17 |
| 164 | 300145 | 南方泵业 | 91,285,036.45  | 32.98 |
| 165 | 300416 | 苏试试验 | 91,210,419.14  | 32.95 |
| 166 | 600596 | 新安股份 | 90,883,226.12  | 32.83 |
| 167 | 000948 | 南天信息 | 90,492,191.46  | 32.69 |
| 168 | 601898 | 中煤能源 | 89,722,616.59  | 32.42 |
| 169 | 002400 | 省广股份 | 89,681,305.54  | 32.40 |
| 170 | 002133 | 广宇集团 | 89,657,680.14  | 32.39 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 171 | 000800 | 一汽轿车 | 89,468,708.00 | 32.32 |
| 172 | 002693 | 双成药业 | 89,418,601.02 | 32.31 |
| 173 | 600016 | 民生银行 | 89,067,396.32 | 32.18 |
| 174 | 300089 | 文化长城 | 88,862,551.01 | 32.10 |
| 175 | 600576 | 万家文化 | 88,245,453.04 | 31.88 |
| 176 | 600077 | 宋都股份 | 88,115,977.44 | 31.84 |
| 177 | 002271 | 东方雨虹 | 87,925,798.44 | 31.77 |
| 178 | 300246 | 宝莱特  | 87,596,561.23 | 31.65 |
| 179 | 600986 | 科达股份 | 87,295,011.39 | 31.54 |
| 180 | 600530 | 交大昂立 | 87,290,608.38 | 31.54 |
| 181 | 000516 | 国际医学 | 86,611,168.16 | 31.29 |
| 182 | 300168 | 万达信息 | 86,556,464.26 | 31.27 |
| 183 | 002262 | 恩华药业 | 86,429,149.61 | 31.23 |
| 184 | 000998 | 隆平高科 | 86,032,424.23 | 31.08 |
| 185 | 600556 | 慧球科技 | 85,769,257.74 | 30.99 |
| 186 | 000633 | 合金投资 | 85,460,430.01 | 30.88 |
| 187 | 002405 | 四维图新 | 85,188,521.58 | 30.78 |
| 188 | 000078 | 海王生物 | 84,975,222.26 | 30.70 |
| 189 | 600293 | 三峡新材 | 84,969,091.18 | 30.70 |
| 190 | 002261 | 拓维信息 | 84,940,495.94 | 30.69 |
| 191 | 601007 | 金陵饭店 | 84,553,182.15 | 30.55 |
| 192 | 300335 | 迪森股份 | 84,344,871.71 | 30.47 |
| 193 | 300271 | 华宇软件 | 84,329,484.15 | 30.47 |
| 194 | 002615 | 哈尔斯  | 84,141,820.73 | 30.40 |
| 195 | 000509 | 华塑控股 | 84,135,739.30 | 30.40 |
| 196 | 300043 | 互动娱乐 | 83,967,435.07 | 30.34 |
| 197 | 300308 | 中际装备 | 83,345,532.68 | 30.11 |
| 198 | 600449 | 宁夏建材 | 83,201,026.58 | 30.06 |
| 199 | 600837 | 海通证券 | 82,170,103.62 | 29.69 |
| 200 | 300114 | 中航电测 | 82,112,923.44 | 29.67 |
| 201 | 300068 | 南都电源 | 82,097,993.21 | 29.66 |
| 202 | 300031 | 宝通科技 | 81,650,889.18 | 29.50 |
| 203 | 002055 | 得润电子 | 81,432,782.92 | 29.42 |
| 204 | 300270 | 中威电子 | 81,397,659.67 | 29.41 |
| 205 | 600118 | 中国卫星 | 81,184,838.19 | 29.33 |
| 206 | 002284 | 亚太股份 | 81,174,044.78 | 29.33 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 207 | 600590 | 泰豪科技 | 80,683,842.65 | 29.15 |
| 208 | 002447 | 壹桥海参 | 80,152,149.35 | 28.96 |
| 209 | 002443 | 金洲管道 | 80,052,242.91 | 28.92 |
| 210 | 002568 | 百润股份 | 79,967,531.83 | 28.89 |
| 211 | 300287 | 飞利信  | 79,959,462.94 | 28.89 |
| 212 | 601328 | 交通银行 | 79,763,017.36 | 28.82 |
| 213 | 300079 | 数码视讯 | 79,109,846.11 | 28.58 |
| 214 | 002256 | 彩虹精化 | 79,063,747.83 | 28.56 |
| 215 | 002494 | 华斯股份 | 78,501,320.45 | 28.36 |
| 216 | 000722 | 湖南发展 | 78,357,518.23 | 28.31 |
| 217 | 300304 | 云意电气 | 78,031,996.50 | 28.19 |
| 218 | 002162 | 悦心健康 | 77,069,072.44 | 27.84 |
| 219 | 600716 | 凤凰股份 | 76,937,265.39 | 27.80 |
| 220 | 600612 | 老凤祥  | 76,672,040.09 | 27.70 |
| 221 | 300125 | 易世达  | 76,589,819.65 | 27.67 |
| 222 | 300419 | 浩丰科技 | 76,543,190.34 | 27.65 |
| 223 | 002338 | 奥普光电 | 75,824,155.47 | 27.39 |
| 224 | 600483 | 福能股份 | 75,736,811.78 | 27.36 |
| 225 | 002385 | 大北农  | 75,608,975.10 | 27.32 |
| 226 | 300119 | 瑞普生物 | 74,508,005.24 | 26.92 |
| 227 | 300457 | 赢合科技 | 74,413,663.19 | 26.88 |
| 228 | 300396 | 迪瑞医疗 | 74,358,825.00 | 26.86 |
| 229 | 300448 | 浩云科技 | 74,003,054.49 | 26.74 |
| 230 | 600501 | 航天晨光 | 73,887,297.78 | 26.69 |
| 231 | 002520 | 日发精机 | 73,864,064.58 | 26.69 |
| 232 | 000728 | 国元证券 | 73,812,324.07 | 26.67 |
| 233 | 600969 | 郴电国际 | 73,317,990.27 | 26.49 |
| 234 | 002343 | 禾欣股份 | 73,186,670.01 | 26.44 |
| 235 | 002656 | 卡奴迪路 | 73,014,429.14 | 26.38 |
| 236 | 300098 | 高新兴  | 72,019,136.42 | 26.02 |
| 237 | 600559 | 老白干酒 | 71,771,237.82 | 25.93 |
| 238 | 002351 | 漫步者  | 71,686,046.67 | 25.90 |
| 239 | 002766 | 索菱股份 | 71,585,620.79 | 25.86 |
| 240 | 000681 | 视觉中国 | 71,578,018.44 | 25.86 |
| 241 | 002668 | 奥马电器 | 71,449,755.36 | 25.81 |
| 242 | 600651 | 飞乐音响 | 71,357,890.53 | 25.78 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 243 | 600855 | 航天长峰 | 70,690,994.38 | 25.54 |
| 244 | 601599 | 鹿港科技 | 70,475,823.67 | 25.46 |
| 245 | 600654 | 中安消  | 70,447,864.67 | 25.45 |
| 246 | 002045 | 国光电器 | 70,217,263.37 | 25.37 |
| 247 | 300205 | 天喻信息 | 69,791,623.65 | 25.21 |
| 248 | 300426 | 唐德影视 | 69,554,633.68 | 25.13 |
| 249 | 000955 | 欣龙控股 | 69,529,686.00 | 25.12 |
| 250 | 002707 | 众信旅游 | 69,500,963.96 | 25.11 |
| 251 | 002516 | 旷达科技 | 69,350,865.02 | 25.06 |
| 252 | 300389 | 艾比森  | 69,146,912.82 | 24.98 |
| 253 | 000831 | 五矿稀土 | 69,146,409.92 | 24.98 |
| 254 | 002502 | 骅威股份 | 68,791,614.18 | 24.85 |
| 255 | 300450 | 先导智能 | 68,516,399.22 | 24.75 |
| 256 | 300045 | 华力创通 | 68,428,013.69 | 24.72 |
| 257 | 300273 | 和佳股份 | 68,187,711.13 | 24.64 |
| 258 | 603939 | 益丰药房 | 67,660,730.07 | 24.44 |
| 259 | 002538 | 司尔特  | 67,453,239.18 | 24.37 |
| 260 | 300058 | 蓝色光标 | 67,441,982.09 | 24.37 |
| 261 | 600552 | 方兴科技 | 67,411,441.11 | 24.35 |
| 262 | 300339 | 润和软件 | 67,269,985.87 | 24.30 |
| 263 | 002467 | 二六三  | 66,885,166.63 | 24.16 |
| 264 | 601628 | 中国人寿 | 66,491,940.68 | 24.02 |
| 265 | 300463 | 迈克生物 | 65,523,679.44 | 23.67 |
| 266 | 600108 | 亚盛集团 | 64,240,865.39 | 23.21 |
| 267 | 300167 | 迪威视讯 | 63,335,758.53 | 22.88 |
| 268 | 600598 | 北大荒  | 63,282,343.94 | 22.86 |
| 269 | 300019 | 硅宝科技 | 63,276,023.92 | 22.86 |
| 270 | 600351 | 亚宝药业 | 63,070,859.74 | 22.79 |
| 271 | 600814 | 杭州解百 | 62,760,947.58 | 22.67 |
| 272 | 002157 | 正邦科技 | 62,715,846.73 | 22.66 |
| 273 | 002273 | 水晶光电 | 61,877,633.86 | 22.36 |
| 274 | 002124 | 天邦股份 | 61,382,641.50 | 22.18 |
| 275 | 000793 | 华闻传媒 | 60,776,114.33 | 21.96 |
| 276 | 600685 | 中船防务 | 60,491,257.08 | 21.85 |
| 277 | 300006 | 莱美药业 | 60,385,765.50 | 21.82 |
| 278 | 600177 | 雅戈尔  | 59,930,473.37 | 21.65 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 279 | 600594 | 益佰制药 | 59,746,583.82 | 21.59 |
| 280 | 002576 | 通达动力 | 59,641,878.23 | 21.55 |
| 281 | 002153 | 石基信息 | 59,393,353.63 | 21.46 |
| 282 | 300030 | 阳普医疗 | 59,020,260.34 | 21.32 |
| 283 | 600028 | 中国石化 | 59,002,803.03 | 21.32 |
| 284 | 300291 | 华录百纳 | 58,825,103.29 | 21.25 |
| 285 | 300274 | 阳光电源 | 58,614,378.92 | 21.18 |
| 286 | 002030 | 达安基因 | 58,061,057.17 | 20.98 |
| 287 | 300036 | 超图软件 | 58,011,199.63 | 20.96 |
| 288 | 002303 | 美盈森  | 56,629,970.33 | 20.46 |
| 289 | 600531 | 豫光金铅 | 56,547,000.17 | 20.43 |
| 290 | 300027 | 华谊兄弟 | 56,144,779.98 | 20.28 |
| 291 | 002182 | 云海金属 | 56,071,089.02 | 20.26 |
| 292 | 002070 | 众和股份 | 55,739,344.66 | 20.14 |
| 293 | 300470 | 日机密封 | 54,999,917.66 | 19.87 |
| 294 | 603918 | 金桥信息 | 54,580,251.56 | 19.72 |
| 295 | 300486 | 东杰智能 | 54,567,016.49 | 19.71 |
| 296 | 600282 | 南钢股份 | 54,505,227.93 | 19.69 |
| 297 | 300358 | 楚天科技 | 54,211,700.45 | 19.59 |
| 298 | 300085 | 银之杰  | 53,834,725.55 | 19.45 |
| 299 | 603718 | 海利生物 | 53,746,115.50 | 19.42 |
| 300 | 601688 | 华泰证券 | 52,579,084.00 | 19.00 |
| 301 | 002296 | 辉煌科技 | 51,951,834.88 | 18.77 |
| 302 | 300109 | 新开源  | 51,582,721.57 | 18.64 |
| 303 | 300005 | 探路者  | 50,657,213.86 | 18.30 |
| 304 | 002095 | 生意宝  | 50,562,037.79 | 18.27 |
| 305 | 300455 | 康拓红外 | 50,456,179.16 | 18.23 |
| 306 | 002020 | 京新药业 | 50,230,495.71 | 18.15 |
| 307 | 002312 | 三泰控股 | 49,389,413.98 | 17.84 |
| 308 | 300299 | 富春通信 | 49,323,366.90 | 17.82 |
| 309 | 002302 | 西部建设 | 49,104,322.50 | 17.74 |
| 310 | 300211 | 亿通科技 | 48,980,204.75 | 17.70 |
| 311 | 002321 | 华英农业 | 48,837,461.35 | 17.64 |
| 312 | 601169 | 北京银行 | 48,757,940.94 | 17.62 |
| 313 | 000538 | 云南白药 | 48,210,711.41 | 17.42 |
| 314 | 002234 | 民和股份 | 47,959,745.69 | 17.33 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 315 | 600637 | 东方明珠 | 47,938,012.53 | 17.32 |
| 316 | 600958 | 东方证券 | 47,799,603.40 | 17.27 |
| 317 | 000732 | 泰禾集团 | 47,644,164.38 | 17.21 |
| 318 | 002318 | 久立特材 | 47,370,153.08 | 17.11 |
| 319 | 300418 | 昆仑万维 | 47,104,673.50 | 17.02 |
| 320 | 600491 | 龙元建设 | 46,813,085.75 | 16.91 |
| 321 | 002172 | 澳洋科技 | 46,294,407.26 | 16.73 |
| 322 | 600305 | 恒顺醋业 | 46,251,975.78 | 16.71 |
| 323 | 002439 | 启明星辰 | 46,026,691.26 | 16.63 |
| 324 | 002390 | 信邦制药 | 45,851,955.31 | 16.57 |
| 325 | 300078 | 思创医惠 | 45,583,608.75 | 16.47 |
| 326 | 600547 | 山东黄金 | 45,268,715.58 | 16.35 |
| 327 | 300237 | 美晨科技 | 44,355,169.38 | 16.02 |
| 328 | 002565 | 上海绿新 | 43,914,386.77 | 15.87 |
| 329 | 600079 | 人福医药 | 43,895,197.63 | 15.86 |
| 330 | 600489 | 中金黄金 | 43,883,052.28 | 15.85 |
| 331 | 601899 | 紫金矿业 | 43,608,114.32 | 15.75 |
| 332 | 002141 | 蓉胜超微 | 43,568,583.30 | 15.74 |
| 333 | 002566 | 益盛药业 | 43,221,458.10 | 15.62 |
| 334 | 601126 | 四方股份 | 43,166,010.04 | 15.60 |
| 335 | 300188 | 美亚柏科 | 42,625,735.50 | 15.40 |
| 336 | 002224 | 三力士  | 42,394,504.50 | 15.32 |
| 337 | 002276 | 万马股份 | 41,845,890.25 | 15.12 |
| 338 | 300004 | 南风股份 | 41,193,286.76 | 14.88 |
| 339 | 002446 | 盛路通信 | 41,168,894.24 | 14.87 |
| 340 | 000963 | 华东医药 | 41,146,290.93 | 14.87 |
| 341 | 002727 | 一心堂  | 40,902,329.74 | 14.78 |
| 342 | 002142 | 宁波银行 | 39,878,754.23 | 14.41 |
| 343 | 000783 | 长江证券 | 39,599,228.59 | 14.31 |
| 344 | 300146 | 汤臣倍健 | 39,534,960.21 | 14.28 |
| 345 | 300324 | 旋极信息 | 39,292,305.82 | 14.20 |
| 346 | 603368 | 柳州医药 | 39,120,863.77 | 14.13 |
| 347 | 002317 | 众生药业 | 39,095,996.25 | 14.12 |
| 348 | 002488 | 金固股份 | 39,000,147.75 | 14.09 |
| 349 | 002771 | 真视通  | 38,674,426.06 | 13.97 |
| 350 | 300096 | 易联众  | 38,387,085.26 | 13.87 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 351 | 000920 | 南方汇通 | 37,888,847.62 | 13.69 |
| 352 | 300348 | 长亮科技 | 37,719,031.50 | 13.63 |
| 353 | 600519 | 贵州茅台 | 36,763,303.48 | 13.28 |
| 354 | 600185 | 格力地产 | 36,082,845.16 | 13.04 |
| 355 | 300241 | 瑞丰光电 | 35,881,469.10 | 12.96 |
| 356 | 600517 | 置信电气 | 35,664,490.36 | 12.89 |
| 357 | 002023 | 海特高新 | 35,179,237.25 | 12.71 |
| 358 | 300314 | 戴维医疗 | 34,828,953.79 | 12.58 |
| 359 | 600030 | 中信证券 | 34,024,696.00 | 12.29 |
| 360 | 002155 | 湖南黄金 | 33,383,111.11 | 12.06 |
| 361 | 601918 | 国投新集 | 33,276,494.53 | 12.02 |
| 362 | 000018 | 神州长城 | 33,022,328.27 | 11.93 |
| 363 | 000423 | 东阿阿胶 | 33,014,843.02 | 11.93 |
| 364 | 002197 | 证通电子 | 32,072,038.68 | 11.59 |
| 365 | 000638 | 万方发展 | 32,033,120.24 | 11.57 |
| 366 | 002100 | 天康生物 | 32,017,169.97 | 11.57 |
| 367 | 000797 | 中国武夷 | 32,013,505.07 | 11.57 |
| 368 | 002048 | 宁波华翔 | 31,215,328.50 | 11.28 |
| 369 | 300086 | 康芝药业 | 31,167,212.14 | 11.26 |
| 370 | 002407 | 多氟多  | 31,162,931.64 | 11.26 |
| 371 | 002655 | 共达电声 | 30,908,887.18 | 11.17 |
| 372 | 002496 | 辉丰股份 | 30,906,252.20 | 11.17 |
| 373 | 600055 | 华润万东 | 30,858,547.77 | 11.15 |
| 374 | 000561 | 烽火电子 | 30,751,733.93 | 11.11 |
| 375 | 300414 | 中光防雷 | 30,252,416.72 | 10.93 |
| 376 | 600251 | 冠农股份 | 29,964,296.53 | 10.83 |
| 377 | 300451 | 创业软件 | 29,661,923.92 | 10.72 |
| 378 | 300128 | 锦富新材 | 29,561,301.78 | 10.68 |
| 379 | 002123 | 荣信股份 | 29,275,918.55 | 10.58 |
| 380 | 002137 | 麦达数字 | 28,951,981.40 | 10.46 |
| 381 | 300170 | 汉得信息 | 28,194,971.85 | 10.19 |
| 382 | 300212 | 易华录  | 28,167,100.15 | 10.18 |
| 383 | 300465 | 高伟达  | 27,511,219.00 | 9.94  |
| 384 | 300309 | 吉艾科技 | 26,992,341.87 | 9.75  |
| 385 | 002159 | 三特索道 | 26,840,811.70 | 9.70  |
| 386 | 601800 | 中国交建 | 26,389,561.84 | 9.53  |



|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 387 | 600284 | 浦东建设 | 26,336,377.40 | 9.51 |
| 388 | 600674 | 川投能源 | 26,264,476.17 | 9.49 |
| 389 | 002673 | 西部证券 | 25,741,941.18 | 9.30 |
| 390 | 002665 | 首航节能 | 25,710,627.83 | 9.29 |
| 391 | 601669 | 中国电建 | 25,249,204.99 | 9.12 |
| 392 | 600850 | 华东电脑 | 24,966,707.49 | 9.02 |
| 393 | 002215 | 诺普信  | 24,667,788.03 | 8.91 |
| 394 | 300458 | 全志科技 | 24,396,518.61 | 8.81 |
| 395 | 002375 | 亚厦股份 | 24,280,207.38 | 8.77 |
| 396 | 601901 | 方正证券 | 23,661,152.97 | 8.55 |
| 397 | 000807 | 云铝股份 | 23,602,104.62 | 8.53 |
| 398 | 600699 | 均胜电子 | 23,245,184.87 | 8.40 |
| 399 | 002151 | 北斗星通 | 23,231,901.81 | 8.39 |
| 400 | 601788 | 光大证券 | 23,210,667.20 | 8.39 |
| 401 | 600153 | 建发股份 | 23,164,877.13 | 8.37 |
| 402 | 600502 | 安徽水利 | 23,138,208.72 | 8.36 |
| 403 | 600739 | 辽宁成大 | 22,882,728.51 | 8.27 |
| 404 | 000776 | 广发证券 | 22,769,184.98 | 8.23 |
| 405 | 603168 | 莎普爱思 | 22,585,945.96 | 8.16 |
| 406 | 002513 | 蓝丰生化 | 22,421,349.03 | 8.10 |
| 407 | 000721 | 西安饮食 | 21,781,938.60 | 7.87 |
| 408 | 300063 | 天龙集团 | 21,669,712.54 | 7.83 |
| 409 | 603883 | 老百姓  | 21,603,095.20 | 7.80 |
| 410 | 600780 | 通宝能源 | 20,978,438.28 | 7.58 |
| 411 | 000603 | 盛达矿业 | 20,852,177.61 | 7.53 |
| 412 | 600648 | 外高桥  | 20,701,944.33 | 7.48 |
| 413 | 000513 | 丽珠集团 | 20,463,425.04 | 7.39 |
| 414 | 300467 | 迅游科技 | 20,416,273.50 | 7.38 |
| 415 | 600572 | 康恩贝  | 20,344,956.81 | 7.35 |
| 416 | 002611 | 东方精工 | 20,095,728.74 | 7.26 |
| 417 | 002051 | 中工国际 | 19,497,601.79 | 7.04 |
| 418 | 600376 | 首开股份 | 19,318,361.88 | 6.98 |
| 419 | 300390 | 天华超净 | 19,079,871.56 | 6.89 |
| 420 | 002717 | 岭南园林 | 18,874,467.00 | 6.82 |
| 421 | 600728 | 佳都科技 | 18,518,634.02 | 6.69 |
| 422 | 603555 | 贵人鸟  | 18,228,211.14 | 6.59 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 423 | 000835 | 长城动漫 | 18,008,779.09 | 6.51 |
| 424 | 603023 | 威帝股份 | 17,942,008.50 | 6.48 |
| 425 | 002152 | 广电运通 | 17,808,323.34 | 6.43 |
| 426 | 000166 | 申万宏源 | 17,391,223.19 | 6.28 |
| 427 | 300284 | 苏交科  | 17,188,197.39 | 6.21 |
| 428 | 601009 | 南京银行 | 17,133,572.56 | 6.19 |
| 429 | 600358 | 国旅联合 | 17,078,061.40 | 6.17 |
| 430 | 603222 | 济民制药 | 16,817,626.10 | 6.08 |
| 431 | 002699 | 美盛文化 | 16,261,638.00 | 5.88 |
| 432 | 600761 | 安徽合力 | 16,059,434.38 | 5.80 |
| 433 | 002316 | 键桥通讯 | 16,009,296.47 | 5.78 |
| 434 | 300359 | 全通教育 | 16,005,413.00 | 5.78 |
| 435 | 600893 | 中航动力 | 15,998,578.89 | 5.78 |
| 436 | 000710 | 天兴仪表 | 15,894,725.83 | 5.74 |
| 437 | 600266 | 北京城建 | 15,516,257.64 | 5.61 |
| 438 | 002285 | 世联行  | 15,377,436.65 | 5.56 |
| 439 | 002004 | 华邦健康 | 15,349,399.36 | 5.55 |
| 440 | 002415 | 海康威视 | 15,302,719.20 | 5.53 |
| 441 | 600518 | 康美药业 | 15,174,311.39 | 5.48 |
| 442 | 002587 | 奥拓电子 | 14,981,238.45 | 5.41 |
| 443 | 002183 | 怡亚通  | 14,979,915.00 | 5.41 |
| 444 | 600270 | 外运发展 | 14,545,302.49 | 5.26 |
| 445 | 002175 | 东方网络 | 14,291,822.40 | 5.16 |
| 446 | 300234 | 开尔新材 | 13,658,010.43 | 4.93 |
| 447 | 600885 | 宏发股份 | 13,583,294.35 | 4.91 |
| 448 | 002366 | 台海核电 | 13,556,125.00 | 4.90 |
| 449 | 600308 | 华泰股份 | 13,440,018.69 | 4.86 |
| 450 | 002138 | 顺络电子 | 13,331,433.55 | 4.82 |
| 451 | 000061 | 农产品  | 13,315,535.00 | 4.81 |
| 452 | 600257 | 大湖股份 | 13,195,358.44 | 4.77 |
| 453 | 002146 | 荣盛发展 | 13,151,585.50 | 4.75 |
| 454 | 300341 | 麦迪电气 | 12,921,155.00 | 4.67 |
| 455 | 600970 | 中材国际 | 12,885,639.15 | 4.66 |
| 456 | 300255 | 常山药业 | 12,646,719.72 | 4.57 |
| 457 | 300101 | 振芯科技 | 12,642,640.20 | 4.57 |
| 458 | 300162 | 雷曼股份 | 12,574,873.00 | 4.54 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 459 | 600588 | 用友网络 | 12,437,282.00 | 4.49 |
| 460 | 300142 | 沃森生物 | 12,344,522.49 | 4.46 |
| 461 | 600420 | 现代制药 | 12,228,439.30 | 4.42 |
| 462 | 000024 | 招商地产 | 11,925,213.52 | 4.31 |
| 463 | 002236 | 大华股份 | 11,895,687.62 | 4.30 |
| 464 | 002139 | 拓邦股份 | 11,681,375.08 | 4.22 |
| 465 | 600126 | 杭钢股份 | 11,630,667.40 | 4.20 |
| 466 | 002280 | 联络互动 | 11,262,352.10 | 4.07 |
| 467 | 600048 | 保利地产 | 11,218,230.77 | 4.05 |
| 468 | 002465 | 海格通信 | 11,069,095.01 | 4.00 |
| 469 | 300206 | 理邦仪器 | 10,760,342.64 | 3.89 |
| 470 | 300232 | 洲明科技 | 10,038,282.95 | 3.63 |
| 471 | 300242 | 明家科技 | 9,931,345.33  | 3.59 |
| 472 | 600584 | 长电科技 | 9,878,451.14  | 3.57 |
| 473 | 002309 | 中利科技 | 9,614,721.38  | 3.47 |
| 474 | 002433 | 太安堂  | 9,107,151.33  | 3.29 |
| 475 | 300446 | 乐凯新材 | 9,058,718.00  | 3.27 |
| 476 | 600826 | 兰生股份 | 8,684,336.00  | 3.14 |
| 477 | 300331 | 苏大维格 | 8,312,201.88  | 3.00 |
| 478 | 600208 | 新湖中宝 | 7,816,717.30  | 2.82 |
| 479 | 002063 | 远光软件 | 7,760,993.30  | 2.80 |
| 480 | 600741 | 华域汽车 | 7,734,219.05  | 2.79 |
| 481 | 601607 | 上海医药 | 7,691,349.00  | 2.78 |
| 482 | 300037 | 新宙邦  | 7,686,268.44  | 2.78 |
| 483 | 002364 | 中恒电气 | 7,667,059.71  | 2.77 |
| 484 | 600005 | 武钢股份 | 7,510,722.00  | 2.71 |
| 485 | 600060 | 海信电器 | 7,443,024.00  | 2.69 |
| 486 | 002586 | 围海股份 | 7,434,114.32  | 2.69 |
| 487 | 002018 | 华信国际 | 7,318,602.00  | 2.64 |
| 488 | 300298 | 三诺生物 | 7,317,676.12  | 2.64 |
| 489 | 300199 | 翰宇药业 | 7,290,632.85  | 2.63 |
| 490 | 000961 | 中南建设 | 7,263,899.87  | 2.62 |
| 491 | 300408 | 三环集团 | 7,155,160.00  | 2.59 |
| 492 | 300376 | 易事特  | 7,099,823.95  | 2.57 |
| 493 | 600809 | 山西汾酒 | 7,082,092.95  | 2.56 |
| 494 | 000911 | 南宁糖业 | 7,062,735.11  | 2.55 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 495 | 000100 | TCL 集团 | 6,973,753.00 | 2.52 |
| 496 | 300334 | 津膜科技   | 6,961,326.70 | 2.52 |
| 497 | 300070 | 碧水源    | 6,953,896.63 | 2.51 |
| 498 | 600135 | 乐凯胶片   | 6,942,489.62 | 2.51 |
| 499 | 000400 | 许继电气   | 6,884,492.00 | 2.49 |
| 500 | 601668 | 中国建筑   | 6,877,853.00 | 2.48 |
| 501 | 601186 | 中国铁建   | 6,874,022.00 | 2.48 |
| 502 | 300227 | 光韵达    | 6,817,544.00 | 2.46 |
| 503 | 300449 | 汉邦高科   | 6,788,251.50 | 2.45 |
| 504 | 300290 | 荣科科技   | 6,564,001.50 | 2.37 |
| 505 | 600418 | 江淮汽车   | 6,507,513.23 | 2.35 |
| 506 | 600008 | 首创股份   | 6,174,687.00 | 2.23 |
| 507 | 002084 | 海鸥卫浴   | 6,104,888.19 | 2.21 |
| 508 | 002358 | 森源电气   | 6,077,548.55 | 2.20 |
| 509 | 600406 | 国电南瑞   | 5,744,637.00 | 2.08 |

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 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  | 002657 | 中科金财 | 1,054,271,243.41 | 380.89         |
| 2  | 300244 | 迪安诊断 | 883,119,623.48   | 319.06         |
| 3  | 300347 | 泰格医药 | 837,135,249.11   | 302.45         |
| 4  | 300075 | 数字政通 | 836,574,901.64   | 302.24         |
| 5  | 300253 | 卫宁软件 | 635,991,338.66   | 229.77         |
| 6  | 600446 | 金证股份 | 576,973,515.58   | 208.45         |
| 7  | 300222 | 科大智能 | 548,542,706.65   | 198.18         |
| 8  | 300033 | 同花顺  | 500,660,113.57   | 180.88         |
| 9  | 300295 | 三六五网 | 492,302,158.72   | 177.86         |
| 10 | 000547 | 航天发展 | 486,954,834.32   | 175.93         |
| 11 | 300248 | 新开普  | 465,598,115.70   | 168.21         |
| 12 | 300016 | 北陆药业 | 450,469,088.90   | 162.75         |
| 13 | 002642 | 荣之联  | 446,352,001.32   | 161.26         |
| 14 | 300018 | 中元华电 | 440,666,075.84   | 159.21         |
| 15 | 300231 | 银信科技 | 435,079,225.48   | 157.19         |
| 16 | 300364 | 中文在线 | 428,854,372.77   | 154.94         |

|    |        |      |                |        |
|----|--------|------|----------------|--------|
| 17 | 300049 | 福瑞股份 | 426,244,188.42 | 154.00 |
| 18 | 002373 | 千方科技 | 396,858,402.27 | 143.38 |
| 19 | 600570 | 恒生电子 | 378,991,440.66 | 136.92 |
| 20 | 300252 | 金信诺  | 365,660,560.96 | 132.11 |
| 21 | 300130 | 新国都  | 334,983,990.29 | 121.02 |
| 22 | 300400 | 劲拓股份 | 328,646,402.51 | 118.74 |
| 23 | 002308 | 威创股份 | 327,250,480.53 | 118.23 |
| 24 | 002462 | 嘉事堂  | 326,079,002.49 | 117.81 |
| 25 | 300178 | 腾邦国际 | 319,510,224.08 | 115.43 |
| 26 | 300010 | 立思辰  | 310,378,536.55 | 112.14 |
| 27 | 603766 | 隆鑫通用 | 308,213,880.36 | 111.35 |
| 28 | 600571 | 信雅达  | 305,222,112.27 | 110.27 |
| 29 | 600820 | 隧道股份 | 295,516,872.74 | 106.77 |
| 30 | 603636 | 南威软件 | 286,417,570.31 | 103.48 |
| 31 | 000858 | 五粮液  | 283,053,275.84 | 102.26 |
| 32 | 300226 | 上海钢联 | 281,613,609.83 | 101.74 |
| 33 | 300140 | 启源装备 | 272,359,197.36 | 98.40  |
| 34 | 300059 | 东方财富 | 272,188,063.31 | 98.34  |
| 35 | 002466 | 天齐锂业 | 266,890,743.07 | 96.42  |
| 36 | 300377 | 赢时胜  | 266,208,023.49 | 96.18  |
| 37 | 002074 | 国轩高科 | 266,156,446.92 | 96.16  |
| 38 | 300254 | 仟源医药 | 265,071,584.25 | 95.77  |
| 39 | 300151 | 昌红科技 | 252,531,137.38 | 91.24  |
| 40 | 600587 | 新华医疗 | 252,340,577.25 | 91.17  |
| 41 | 300380 | 安硕信息 | 247,649,337.88 | 89.47  |
| 42 | 002022 | 科华生物 | 247,298,373.69 | 89.35  |
| 43 | 300165 | 天瑞仪器 | 243,596,994.09 | 88.01  |
| 44 | 002460 | 赣锋锂业 | 237,507,316.20 | 85.81  |
| 45 | 601021 | 春秋航空 | 232,483,160.58 | 83.99  |
| 46 | 300439 | 美康生物 | 225,794,593.25 | 81.58  |
| 47 | 002381 | 双箭股份 | 220,532,765.20 | 79.68  |
| 48 | 300409 | 道氏技术 | 219,946,115.17 | 79.46  |
| 49 | 600834 | 申通地铁 | 218,285,748.82 | 78.86  |
| 50 | 600655 | 豫园商城 | 215,981,776.85 | 78.03  |
| 51 | 600827 | 百联股份 | 215,604,288.14 | 77.89  |
| 52 | 300447 | 全信股份 | 215,433,588.28 | 77.83  |
| 53 | 600391 | 成发科技 | 214,898,451.85 | 77.64  |
| 54 | 601555 | 东吴证券 | 212,354,476.04 | 76.72  |

|    |        |      |                |       |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 55 | 000158 | 常山股份 | 211,699,840.89 | 76.48 |
| 56 | 300378 | 鼎捷软件 | 204,951,271.97 | 74.05 |
| 57 | 002747 | 埃斯顿  | 200,042,797.87 | 72.27 |
| 58 | 300113 | 顺网科技 | 199,858,913.14 | 72.21 |
| 59 | 300144 | 宋城演艺 | 199,175,741.97 | 71.96 |
| 60 | 600677 | 航天通信 | 197,277,048.03 | 71.27 |
| 61 | 601166 | 兴业银行 | 195,664,941.67 | 70.69 |
| 62 | 300012 | 华测检测 | 194,780,688.30 | 70.37 |
| 63 | 300392 | 腾信股份 | 194,386,049.34 | 70.23 |
| 64 | 002472 | 双环传动 | 194,225,135.50 | 70.17 |
| 65 | 300022 | 吉峰农机 | 191,606,781.90 | 69.22 |
| 66 | 300468 | 四方精创 | 189,533,338.73 | 68.48 |
| 67 | 002589 | 瑞康医药 | 189,144,545.81 | 68.34 |
| 68 | 300379 | 东方通  | 185,624,474.37 | 67.06 |
| 69 | 002060 | 粤水电  | 182,467,510.11 | 65.92 |
| 70 | 300413 | 快乐购  | 179,496,171.61 | 64.85 |
| 71 | 600895 | 张江高科 | 173,030,645.40 | 62.51 |
| 72 | 002714 | 牧原股份 | 171,237,891.85 | 61.87 |
| 73 | 300404 | 博济医药 | 170,926,162.82 | 61.75 |
| 74 | 600410 | 华胜天成 | 169,426,361.80 | 61.21 |
| 75 | 600663 | 陆家嘴  | 167,709,505.36 | 60.59 |
| 76 | 300166 | 东方国信 | 167,381,707.29 | 60.47 |
| 77 | 300009 | 安科生物 | 165,131,276.52 | 59.66 |
| 78 | 300147 | 香雪制药 | 163,579,637.50 | 59.10 |
| 79 | 601377 | 兴业证券 | 161,408,562.06 | 58.31 |
| 80 | 300442 | 普丽盛  | 159,072,895.32 | 57.47 |
| 81 | 300155 | 安居宝  | 158,759,682.79 | 57.36 |
| 82 | 600038 | 中直股份 | 157,852,505.74 | 57.03 |
| 83 | 601988 | 中国银行 | 157,036,731.91 | 56.74 |
| 84 | 600029 | 南方航空 | 155,249,712.25 | 56.09 |
| 85 | 300251 | 光线传媒 | 154,862,526.30 | 55.95 |
| 86 | 601288 | 农业银行 | 153,514,689.36 | 55.46 |
| 87 | 002551 | 尚荣医疗 | 152,919,951.47 | 55.25 |
| 88 | 600990 | 四创电子 | 149,933,676.11 | 54.17 |
| 89 | 300223 | 北京君正 | 148,033,365.29 | 53.48 |
| 90 | 300352 | 北信源  | 147,186,613.55 | 53.18 |
| 91 | 002594 | 比亚迪  | 145,955,344.61 | 52.73 |
| 92 | 002363 | 隆基机械 | 144,013,720.36 | 52.03 |

|     |        |      |                |       |
|-----|--------|------|----------------|-------|
| 93  | 300238 | 冠昊生物 | 142,984,553.13 | 51.66 |
| 94  | 600172 | 黄河旋风 | 142,319,001.33 | 51.42 |
| 95  | 600009 | 上海机场 | 140,891,617.46 | 50.90 |
| 96  | 300398 | 飞凯材料 | 138,672,254.58 | 50.10 |
| 97  | 300356 | 光一科技 | 138,300,176.33 | 49.97 |
| 98  | 300397 | 天和防务 | 137,619,743.99 | 49.72 |
| 99  | 002332 | 仙琚制药 | 137,386,422.46 | 49.64 |
| 100 | 002108 | 沧州明珠 | 137,019,999.41 | 49.50 |
| 101 | 300171 | 东富龙  | 136,900,822.04 | 49.46 |
| 102 | 600138 | 中青旅  | 136,679,870.68 | 49.38 |
| 103 | 000802 | 北京文化 | 135,793,774.93 | 49.06 |
| 104 | 002205 | 国统股份 | 135,088,896.43 | 48.81 |
| 105 | 300131 | 英唐智控 | 134,825,623.10 | 48.71 |
| 106 | 300003 | 乐普医疗 | 133,972,419.33 | 48.40 |
| 107 | 600513 | 联环药业 | 133,801,810.45 | 48.34 |
| 108 | 300038 | 梅泰诺  | 133,576,758.55 | 48.26 |
| 109 | 600749 | 西藏旅游 | 133,116,282.02 | 48.09 |
| 110 | 600109 | 国金证券 | 132,279,566.90 | 47.79 |
| 111 | 300186 | 大华农  | 127,511,410.46 | 46.07 |
| 112 | 300367 | 东方网力 | 126,321,273.04 | 45.64 |
| 113 | 300399 | 京天利  | 126,227,842.55 | 45.60 |
| 114 | 300440 | 运达科技 | 125,533,593.62 | 45.35 |
| 115 | 002260 | 德奥通航 | 125,522,202.88 | 45.35 |
| 116 | 600292 | 中电远达 | 123,011,540.70 | 44.44 |
| 117 | 002436 | 兴森科技 | 122,389,699.74 | 44.22 |
| 118 | 002184 | 海得控制 | 121,658,010.10 | 43.95 |
| 119 | 000568 | 泸州老窖 | 120,221,084.59 | 43.43 |
| 120 | 600115 | 东方航空 | 119,282,013.67 | 43.09 |
| 121 | 002372 | 伟星新材 | 116,045,978.57 | 41.93 |
| 122 | 002344 | 海宁皮城 | 115,652,164.76 | 41.78 |
| 123 | 601318 | 中国平安 | 114,694,101.18 | 41.44 |
| 124 | 300336 | 新文化  | 114,652,746.93 | 41.42 |
| 125 | 300250 | 初灵信息 | 112,713,142.93 | 40.72 |
| 126 | 002715 | 登云股份 | 112,280,465.32 | 40.57 |
| 127 | 300219 | 鸿利光电 | 111,450,242.04 | 40.27 |
| 128 | 002664 | 信质电机 | 110,706,870.15 | 40.00 |
| 129 | 600879 | 航天电子 | 109,289,915.98 | 39.48 |
| 130 | 002343 | 禾欣股份 | 108,615,192.83 | 39.24 |

|     |        |      |                |       |
|-----|--------|------|----------------|-------|
| 131 | 002445 | 中南重工 | 108,168,351.90 | 39.08 |
| 132 | 600701 | 工大高新 | 107,926,477.31 | 38.99 |
| 133 | 002425 | 凯撒股份 | 106,925,040.66 | 38.63 |
| 134 | 002609 | 捷顺科技 | 104,993,784.95 | 37.93 |
| 135 | 601211 | 国泰君安 | 104,527,833.83 | 37.76 |
| 136 | 600276 | 恒瑞医药 | 104,290,481.07 | 37.68 |
| 137 | 002477 | 雏鹰农牧 | 103,130,562.05 | 37.26 |
| 138 | 002279 | 久其软件 | 103,096,570.75 | 37.25 |
| 139 | 601398 | 工商银行 | 102,480,659.51 | 37.02 |
| 140 | 002271 | 东方雨虹 | 100,880,294.19 | 36.45 |
| 141 | 300198 | 纳川股份 | 100,751,977.39 | 36.40 |
| 142 | 002518 | 科士达  | 100,635,218.68 | 36.36 |
| 143 | 002070 | 众和股份 | 100,054,607.47 | 36.15 |
| 144 | 000906 | 物产中拓 | 99,449,889.30  | 35.93 |
| 145 | 300133 | 华策影视 | 99,291,782.74  | 35.87 |
| 146 | 300043 | 互动娱乐 | 98,183,916.16  | 35.47 |
| 147 | 002025 | 航天电器 | 97,005,037.68  | 35.05 |
| 148 | 300304 | 云意电气 | 96,607,440.89  | 34.90 |
| 149 | 600986 | 科达股份 | 96,273,024.53  | 34.78 |
| 150 | 002329 | 皇氏集团 | 96,027,650.77  | 34.69 |
| 151 | 002290 | 禾盛新材 | 94,874,239.13  | 34.28 |
| 152 | 000673 | 当代东方 | 94,819,340.60  | 34.26 |
| 153 | 002457 | 青龙管业 | 94,756,748.02  | 34.23 |
| 154 | 300145 | 南方泵业 | 94,169,418.21  | 34.02 |
| 155 | 300416 | 苏试试验 | 93,955,283.38  | 33.94 |
| 156 | 002707 | 众信旅游 | 93,751,817.17  | 33.87 |
| 157 | 601007 | 金陵饭店 | 93,121,967.76  | 33.64 |
| 158 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 93,062,996.67  | 33.62 |
| 159 | 002284 | 亚太股份 | 92,348,820.37  | 33.36 |
| 160 | 002262 | 恩华药业 | 92,260,630.40  | 33.33 |
| 161 | 600501 | 航天晨光 | 91,760,367.17  | 33.15 |
| 162 | 300168 | 万达信息 | 90,964,282.32  | 32.86 |
| 163 | 600837 | 海通证券 | 90,211,523.55  | 32.59 |
| 164 | 600343 | 航天动力 | 90,048,500.19  | 32.53 |
| 165 | 002405 | 四维图新 | 89,861,495.31  | 32.47 |
| 166 | 000722 | 湖南发展 | 89,524,632.52  | 32.34 |
| 167 | 600016 | 民生银行 | 89,405,603.65  | 32.30 |
| 168 | 600576 | 万家文化 | 88,001,585.72  | 31.79 |



|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 169 | 002026 | 山东威达 | 87,894,468.03 | 31.76 |
| 170 | 601898 | 中煤能源 | 87,796,362.39 | 31.72 |
| 171 | 002261 | 拓维信息 | 87,136,579.26 | 31.48 |
| 172 | 002746 | 仙坛股份 | 87,132,814.67 | 31.48 |
| 173 | 300114 | 中航电测 | 87,042,810.63 | 31.45 |
| 174 | 002299 | 圣农发展 | 86,971,010.23 | 31.42 |
| 175 | 600118 | 中国卫星 | 86,254,218.86 | 31.16 |
| 176 | 600716 | 凤凰股份 | 86,177,610.67 | 31.13 |
| 177 | 002338 | 奥普光电 | 85,776,197.70 | 30.99 |
| 178 | 300068 | 南都电源 | 85,503,045.54 | 30.89 |
| 179 | 300287 | 飞利信  | 84,999,416.11 | 30.71 |
| 180 | 002711 | 欧浦智网 | 84,101,092.08 | 30.38 |
| 181 | 600077 | 宋都股份 | 83,981,788.65 | 30.34 |
| 182 | 600596 | 新安股份 | 83,923,530.81 | 30.32 |
| 183 | 600855 | 航天长峰 | 83,853,249.50 | 30.29 |
| 184 | 000948 | 南天信息 | 83,428,603.54 | 30.14 |
| 185 | 000800 | 一汽轿车 | 83,237,293.81 | 30.07 |
| 186 | 002256 | 彩虹精化 | 83,198,557.54 | 30.06 |
| 187 | 600645 | 中源协和 | 83,130,453.54 | 30.03 |
| 188 | 000633 | 合金投资 | 83,080,429.03 | 30.02 |
| 189 | 002693 | 双成药业 | 83,075,802.36 | 30.01 |
| 190 | 000998 | 隆平高科 | 83,005,714.64 | 29.99 |
| 191 | 002443 | 金洲管道 | 82,995,251.80 | 29.99 |
| 192 | 600530 | 交大昂立 | 82,882,371.78 | 29.94 |
| 193 | 000516 | 国际医学 | 82,187,368.64 | 29.69 |
| 194 | 300271 | 华宇软件 | 81,547,301.73 | 29.46 |
| 195 | 000728 | 国元证券 | 81,275,234.73 | 29.36 |
| 196 | 002055 | 得润电子 | 80,409,523.29 | 29.05 |
| 197 | 300045 | 华力创通 | 80,261,444.10 | 29.00 |
| 198 | 002447 | 壹桥海参 | 79,877,062.67 | 28.86 |
| 199 | 300031 | 宝通科技 | 79,606,839.71 | 28.76 |
| 200 | 300463 | 迈克生物 | 79,125,947.48 | 28.59 |
| 201 | 600449 | 宁夏建材 | 79,017,112.36 | 28.55 |
| 202 | 002400 | 省广股份 | 78,527,217.05 | 28.37 |
| 203 | 002615 | 哈尔斯  | 77,795,936.20 | 28.11 |
| 204 | 000509 | 华塑控股 | 77,748,492.95 | 28.09 |
| 205 | 300335 | 迪森股份 | 76,115,394.67 | 27.50 |
| 206 | 002520 | 日发精机 | 75,504,426.13 | 27.28 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 207 | 002568 | 百润股份 | 75,353,364.34 | 27.22 |
| 208 | 300396 | 迪瑞医疗 | 74,545,918.32 | 26.93 |
| 209 | 600612 | 老凤祥  | 74,320,647.02 | 26.85 |
| 210 | 300205 | 天喻信息 | 74,277,430.66 | 26.84 |
| 211 | 601328 | 交通银行 | 74,157,060.71 | 26.79 |
| 212 | 300098 | 高新兴  | 73,913,234.78 | 26.70 |
| 213 | 600590 | 泰豪科技 | 73,754,374.86 | 26.65 |
| 214 | 300450 | 先导智能 | 73,241,985.28 | 26.46 |
| 215 | 600651 | 飞乐音响 | 73,068,222.05 | 26.40 |
| 216 | 002385 | 大北农  | 72,981,688.14 | 26.37 |
| 217 | 603939 | 益丰药房 | 72,319,962.98 | 26.13 |
| 218 | 300079 | 数码视讯 | 72,168,514.01 | 26.07 |
| 219 | 601628 | 中国人寿 | 71,982,426.29 | 26.01 |
| 220 | 000955 | 欣龙控股 | 71,883,129.51 | 25.97 |
| 221 | 300419 | 浩丰科技 | 71,167,072.05 | 25.71 |
| 222 | 002668 | 奥马电器 | 71,160,909.73 | 25.71 |
| 223 | 002494 | 华斯股份 | 70,908,993.25 | 25.62 |
| 224 | 002351 | 漫步者  | 70,530,654.09 | 25.48 |
| 225 | 300119 | 瑞普生物 | 69,749,491.90 | 25.20 |
| 226 | 002516 | 旷达科技 | 69,398,595.58 | 25.07 |
| 227 | 300457 | 赢合科技 | 69,098,027.62 | 24.96 |
| 228 | 002162 | 悦心健康 | 68,309,264.30 | 24.68 |
| 229 | 300167 | 迪威视讯 | 67,909,322.91 | 24.53 |
| 230 | 002095 | 生意宝  | 67,267,536.17 | 24.30 |
| 231 | 300058 | 蓝色光标 | 67,128,836.01 | 24.25 |
| 232 | 300273 | 和佳股份 | 66,956,020.65 | 24.19 |
| 233 | 002045 | 国光电器 | 66,831,184.56 | 24.15 |
| 234 | 603918 | 金桥信息 | 65,962,173.34 | 23.83 |
| 235 | 300036 | 超图软件 | 65,905,072.19 | 23.81 |
| 236 | 600351 | 亚宝药业 | 65,882,704.82 | 23.80 |
| 237 | 601688 | 华泰证券 | 65,617,010.59 | 23.71 |
| 238 | 300426 | 唐德影视 | 64,896,032.95 | 23.45 |
| 239 | 000831 | 五矿稀土 | 64,842,333.29 | 23.43 |
| 240 | 600814 | 杭州解百 | 64,687,080.42 | 23.37 |
| 241 | 300389 | 艾比森  | 64,530,331.78 | 23.31 |
| 242 | 600177 | 雅戈尔  | 64,242,117.51 | 23.21 |
| 243 | 601599 | 鹿港科技 | 64,041,852.14 | 23.14 |
| 244 | 600552 | 方兴科技 | 64,013,800.85 | 23.13 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 245 | 600654 | 中安消  | 63,373,274.97 | 22.90 |
| 246 | 600483 | 福能股份 | 63,202,664.63 | 22.83 |
| 247 | 002538 | 司尔特  | 62,891,641.20 | 22.72 |
| 248 | 600598 | 北大荒  | 62,208,738.85 | 22.48 |
| 249 | 002172 | 澳洋科技 | 61,611,301.32 | 22.26 |
| 250 | 002030 | 达安基因 | 61,517,782.30 | 22.23 |
| 251 | 002273 | 水晶光电 | 61,317,789.74 | 22.15 |
| 252 | 300125 | 易世达  | 61,155,685.93 | 22.09 |
| 253 | 600969 | 郴电国际 | 60,821,855.77 | 21.97 |
| 254 | 300274 | 阳光电源 | 60,319,109.71 | 21.79 |
| 255 | 600108 | 亚盛集团 | 58,546,013.14 | 21.15 |
| 256 | 002576 | 通达动力 | 58,467,220.81 | 21.12 |
| 257 | 300019 | 硅宝科技 | 58,347,225.48 | 21.08 |
| 258 | 600594 | 益佰制药 | 58,253,308.53 | 21.05 |
| 259 | 600559 | 老白干酒 | 57,220,590.61 | 20.67 |
| 260 | 600028 | 中国石化 | 57,068,938.74 | 20.62 |
| 261 | 600531 | 豫光金铅 | 57,055,458.57 | 20.61 |
| 262 | 002157 | 正邦科技 | 57,020,584.79 | 20.60 |
| 263 | 002303 | 美盈森  | 56,614,701.96 | 20.45 |
| 264 | 002439 | 启明星辰 | 56,526,182.08 | 20.42 |
| 265 | 600685 | 中船防务 | 56,059,022.60 | 20.25 |
| 266 | 300470 | 日机密封 | 55,524,044.40 | 20.06 |
| 267 | 300109 | 新开源  | 55,180,047.81 | 19.94 |
| 268 | 002020 | 京新药业 | 54,852,214.02 | 19.82 |
| 269 | 002153 | 石基信息 | 54,490,744.91 | 19.69 |
| 270 | 600958 | 东方证券 | 54,180,007.19 | 19.57 |
| 271 | 002124 | 天邦股份 | 54,160,485.22 | 19.57 |
| 272 | 300006 | 莱美药业 | 54,011,042.85 | 19.51 |
| 273 | 002766 | 索菱股份 | 53,946,947.98 | 19.49 |
| 274 | 300030 | 阳普医疗 | 53,618,902.67 | 19.37 |
| 275 | 002182 | 云海金属 | 53,315,393.15 | 19.26 |
| 276 | 300358 | 楚天科技 | 52,542,834.06 | 18.98 |
| 277 | 002312 | 三泰控股 | 52,054,902.82 | 18.81 |
| 278 | 603718 | 海利生物 | 52,048,448.40 | 18.80 |
| 279 | 300291 | 华录百纳 | 51,460,079.22 | 18.59 |
| 280 | 300418 | 昆仑万维 | 50,785,802.38 | 18.35 |
| 281 | 300211 | 亿通科技 | 50,693,669.88 | 18.31 |
| 282 | 300027 | 华谊兄弟 | 50,663,564.72 | 18.30 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 283 | 600282 | 南钢股份 | 50,621,921.75 | 18.29 |
| 284 | 002318 | 久立特材 | 50,435,964.89 | 18.22 |
| 285 | 600637 | 东方明珠 | 49,969,280.18 | 18.05 |
| 286 | 300455 | 康拓红外 | 49,563,561.61 | 17.91 |
| 287 | 000538 | 云南白药 | 49,542,319.43 | 17.90 |
| 288 | 600305 | 恒顺醋业 | 49,394,169.50 | 17.85 |
| 289 | 000732 | 泰禾集团 | 49,372,539.33 | 17.84 |
| 290 | 002276 | 万马股份 | 48,825,012.51 | 17.64 |
| 291 | 300085 | 银之杰  | 48,711,442.07 | 17.60 |
| 292 | 601169 | 北京银行 | 48,261,123.59 | 17.44 |
| 293 | 002234 | 民和股份 | 47,878,019.11 | 17.30 |
| 294 | 300005 | 探路者  | 47,780,329.92 | 17.26 |
| 295 | 300299 | 富春通信 | 47,585,677.79 | 17.19 |
| 296 | 300078 | 思创医惠 | 46,680,449.87 | 16.86 |
| 297 | 601126 | 四方股份 | 46,214,323.98 | 16.70 |
| 298 | 600079 | 人福医药 | 46,131,762.71 | 16.67 |
| 299 | 002390 | 信邦制药 | 46,111,140.28 | 16.66 |
| 300 | 600491 | 龙元建设 | 45,636,809.87 | 16.49 |
| 301 | 300051 | 三五互联 | 44,755,946.81 | 16.17 |
| 302 | 002302 | 西部建设 | 44,733,731.09 | 16.16 |
| 303 | 000783 | 长江证券 | 44,684,828.81 | 16.14 |
| 304 | 002566 | 益盛药业 | 44,642,851.18 | 16.13 |
| 305 | 002321 | 华英农业 | 43,994,392.60 | 15.89 |
| 306 | 300146 | 汤臣倍健 | 43,988,392.39 | 15.89 |
| 307 | 002565 | 上海绿新 | 43,404,888.13 | 15.68 |
| 308 | 300004 | 南风股份 | 43,116,688.02 | 15.58 |
| 309 | 600556 | 慧球科技 | 42,699,583.32 | 15.43 |
| 310 | 002317 | 众生药业 | 42,277,190.81 | 15.27 |
| 311 | 002296 | 辉煌科技 | 42,232,117.04 | 15.26 |
| 312 | 002771 | 真视通  | 41,476,773.29 | 14.98 |
| 313 | 002488 | 金固股份 | 40,475,387.70 | 14.62 |
| 314 | 300096 | 易联众  | 39,952,557.00 | 14.43 |
| 315 | 000963 | 华东医药 | 39,880,235.16 | 14.41 |
| 316 | 002141 | 睿胜超微 | 39,045,558.06 | 14.11 |
| 317 | 603368 | 柳州医药 | 38,940,256.06 | 14.07 |
| 318 | 002142 | 宁波银行 | 38,415,507.41 | 13.88 |
| 319 | 000018 | 神州长城 | 38,035,484.38 | 13.74 |
| 320 | 002727 | 一心堂  | 37,683,902.45 | 13.61 |

|     |        |      |               |       |
|-----|--------|------|---------------|-------|
| 321 | 600030 | 中信证券 | 37,402,571.84 | 13.51 |
| 322 | 600519 | 贵州茅台 | 37,220,273.55 | 13.45 |
| 323 | 002224 | 三力士  | 37,214,592.82 | 13.45 |
| 324 | 300188 | 美亚柏科 | 37,034,727.76 | 13.38 |
| 325 | 601899 | 紫金矿业 | 36,508,887.08 | 13.19 |
| 326 | 300237 | 美晨科技 | 36,508,053.97 | 13.19 |
| 327 | 600517 | 置信电气 | 36,135,749.18 | 13.06 |
| 328 | 600547 | 山东黄金 | 36,021,437.62 | 13.01 |
| 329 | 300339 | 润和软件 | 35,649,567.70 | 12.88 |
| 330 | 300086 | 康芝药业 | 35,378,395.69 | 12.78 |
| 331 | 002407 | 多氟多  | 35,169,765.88 | 12.71 |
| 332 | 300314 | 戴维医疗 | 35,130,340.78 | 12.69 |
| 333 | 600489 | 中金黄金 | 35,127,810.12 | 12.69 |
| 334 | 600185 | 格力地产 | 34,915,950.30 | 12.61 |
| 335 | 300348 | 长亮科技 | 34,357,072.75 | 12.41 |
| 336 | 002023 | 海特高新 | 33,918,929.45 | 12.25 |
| 337 | 000423 | 东阿阿胶 | 33,412,609.92 | 12.07 |
| 338 | 000561 | 烽火电子 | 32,205,935.18 | 11.64 |
| 339 | 300465 | 高伟达  | 31,879,527.80 | 11.52 |
| 340 | 002137 | 麦达数字 | 31,718,914.24 | 11.46 |
| 341 | 002197 | 证通电子 | 31,330,121.12 | 11.32 |
| 342 | 600055 | 华润万东 | 31,222,050.98 | 11.28 |
| 343 | 000638 | 万方发展 | 31,192,642.99 | 11.27 |
| 344 | 300448 | 浩云科技 | 31,055,954.24 | 11.22 |
| 345 | 002496 | 辉丰股份 | 31,051,135.69 | 11.22 |
| 346 | 002048 | 宁波华翔 | 30,810,209.20 | 11.13 |
| 347 | 300315 | 掌趣科技 | 30,446,183.14 | 11.00 |
| 348 | 600251 | 冠农股份 | 30,425,889.29 | 10.99 |
| 349 | 300170 | 汉得信息 | 30,020,702.18 | 10.85 |
| 350 | 300128 | 锦富新材 | 29,959,053.97 | 10.82 |
| 351 | 002100 | 天康生物 | 29,943,603.59 | 10.82 |
| 352 | 601918 | 国投新集 | 29,678,512.43 | 10.72 |
| 353 | 002123 | 荣信股份 | 28,969,643.51 | 10.47 |
| 354 | 603168 | 莎普爱思 | 28,666,047.50 | 10.36 |
| 355 | 300414 | 中光防雷 | 28,004,927.92 | 10.12 |
| 356 | 600674 | 川投能源 | 27,997,034.68 | 10.11 |
| 357 | 002133 | 广宇集团 | 27,047,813.36 | 9.77  |
| 358 | 002665 | 首航节能 | 26,783,038.83 | 9.68  |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 359 | 600284 | 浦东建设 | 26,672,187.52 | 9.64 |
| 360 | 300451 | 创业软件 | 26,322,075.07 | 9.51 |
| 361 | 300212 | 易华录  | 26,254,231.57 | 9.49 |
| 362 | 002502 | 骅威股份 | 26,102,380.09 | 9.43 |
| 363 | 600699 | 均胜电子 | 26,058,714.24 | 9.41 |
| 364 | 601800 | 中国交建 | 25,984,498.32 | 9.39 |
| 365 | 000797 | 中国武夷 | 25,428,873.83 | 9.19 |
| 366 | 002155 | 湖南黄金 | 25,421,003.76 | 9.18 |
| 367 | 601669 | 中国电建 | 25,264,231.00 | 9.13 |
| 368 | 000807 | 云铝股份 | 24,575,562.58 | 8.88 |
| 369 | 002375 | 亚厦股份 | 24,312,353.43 | 8.78 |
| 370 | 600850 | 华东电脑 | 24,299,955.72 | 8.78 |
| 371 | 002215 | 诺普信  | 24,285,017.99 | 8.77 |
| 372 | 601901 | 方正证券 | 24,131,441.61 | 8.72 |
| 373 | 000721 | 西安饮食 | 23,720,382.16 | 8.57 |
| 374 | 002673 | 西部证券 | 23,554,940.20 | 8.51 |
| 375 | 601788 | 光大证券 | 23,472,217.86 | 8.48 |
| 376 | 000513 | 丽珠集团 | 23,307,282.09 | 8.42 |
| 377 | 600502 | 安徽水利 | 23,218,496.60 | 8.39 |
| 378 | 600739 | 辽宁成大 | 23,068,314.37 | 8.33 |
| 379 | 000776 | 广发证券 | 22,979,307.00 | 8.30 |
| 380 | 300467 | 迅游科技 | 22,709,275.66 | 8.20 |
| 381 | 600780 | 通宝能源 | 22,704,753.47 | 8.20 |
| 382 | 300063 | 天龙集团 | 22,644,013.89 | 8.18 |
| 383 | 002159 | 三特索道 | 22,010,257.84 | 7.95 |
| 384 | 600153 | 建发股份 | 21,786,060.15 | 7.87 |
| 385 | 000603 | 盛达矿业 | 21,732,411.15 | 7.85 |
| 386 | 002513 | 蓝丰生化 | 21,315,979.22 | 7.70 |
| 387 | 002151 | 北斗星通 | 21,225,996.10 | 7.67 |
| 388 | 601009 | 南京银行 | 21,009,482.28 | 7.59 |
| 389 | 600572 | 康恩贝  | 20,820,200.86 | 7.52 |
| 390 | 600622 | 嘉宝集团 | 20,294,172.21 | 7.33 |
| 391 | 603883 | 老百姓  | 19,997,522.92 | 7.22 |
| 392 | 002611 | 东方精工 | 19,823,342.10 | 7.16 |
| 393 | 600728 | 佳都科技 | 19,546,072.41 | 7.06 |
| 394 | 300246 | 宝莱特  | 19,482,353.49 | 7.04 |
| 395 | 603555 | 贵人鸟  | 19,414,324.66 | 7.01 |
| 396 | 600376 | 首开股份 | 19,000,326.15 | 6.86 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 397 | 000024 | 招商地产 | 18,998,202.15 | 6.86 |
| 398 | 002004 | 华邦健康 | 18,798,067.05 | 6.79 |
| 399 | 600358 | 国旅联合 | 18,789,199.30 | 6.79 |
| 400 | 600648 | 外高桥  | 18,744,723.48 | 6.77 |
| 401 | 002146 | 荣盛发展 | 18,630,941.62 | 6.73 |
| 402 | 002717 | 岭南园林 | 18,468,275.60 | 6.67 |
| 403 | 600048 | 保利地产 | 18,315,530.43 | 6.62 |
| 404 | 300284 | 苏交科  | 18,211,528.19 | 6.58 |
| 405 | 002051 | 中工国际 | 18,001,937.91 | 6.50 |
| 406 | 603222 | 济民制药 | 17,544,994.98 | 6.34 |
| 407 | 300390 | 天华超净 | 17,428,456.34 | 6.30 |
| 408 | 600518 | 康美药业 | 17,092,630.69 | 6.18 |
| 409 | 300101 | 振芯科技 | 16,971,735.47 | 6.13 |
| 410 | 000166 | 申万宏源 | 16,970,500.00 | 6.13 |
| 411 | 002152 | 广电运通 | 16,485,292.00 | 5.96 |
| 412 | 002316 | 键桥通讯 | 16,135,918.25 | 5.83 |
| 413 | 002699 | 美盛文化 | 16,122,960.21 | 5.82 |
| 414 | 002446 | 盛路通信 | 15,835,304.14 | 5.72 |
| 415 | 300359 | 全通教育 | 15,767,427.60 | 5.70 |
| 416 | 000710 | 天兴仪表 | 15,740,816.02 | 5.69 |
| 417 | 000793 | 华闻传媒 | 15,722,992.30 | 5.68 |
| 418 | 600266 | 北京城建 | 15,671,229.57 | 5.66 |
| 419 | 600761 | 安徽合力 | 15,668,690.47 | 5.66 |
| 420 | 600893 | 中航动力 | 15,648,584.65 | 5.65 |
| 421 | 002183 | 怡亚通  | 15,443,035.72 | 5.58 |
| 422 | 002587 | 奥拓电子 | 15,363,697.83 | 5.55 |
| 423 | 002415 | 海康威视 | 15,345,379.70 | 5.54 |
| 424 | 300341 | 麦迪电气 | 15,116,376.92 | 5.46 |
| 425 | 300255 | 常山药业 | 15,092,890.82 | 5.45 |
| 426 | 600270 | 外运发展 | 14,272,169.72 | 5.16 |
| 427 | 002138 | 顺络电子 | 14,150,443.14 | 5.11 |
| 428 | 600970 | 中材国际 | 14,044,910.22 | 5.07 |
| 429 | 002188 | 新嘉联  | 13,885,615.13 | 5.02 |
| 430 | 002285 | 世联行  | 13,764,935.88 | 4.97 |
| 431 | 600885 | 宏发股份 | 13,760,675.69 | 4.97 |
| 432 | 000961 | 中南建设 | 13,442,847.20 | 4.86 |
| 433 | 000681 | 视觉中国 | 13,410,092.86 | 4.84 |
| 434 | 300142 | 沃森生物 | 13,313,825.28 | 4.81 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 435 | 600308 | 华泰股份 | 13,263,331.77 | 4.79 |
| 436 | 600257 | 大湖股份 | 13,222,464.00 | 4.78 |
| 437 | 000920 | 南方汇通 | 13,147,022.00 | 4.75 |
| 438 | 000061 | 农产品  | 12,957,003.57 | 4.68 |
| 439 | 002467 | 二六三  | 12,615,181.58 | 4.56 |
| 440 | 300162 | 雷曼股份 | 12,456,463.50 | 4.50 |
| 441 | 002366 | 台海核电 | 12,435,868.24 | 4.49 |
| 442 | 002280 | 联络互动 | 12,370,134.23 | 4.47 |
| 443 | 600208 | 新湖中宝 | 12,367,908.86 | 4.47 |
| 444 | 002236 | 大华股份 | 12,073,323.55 | 4.36 |
| 445 | 600126 | 杭钢股份 | 11,662,972.93 | 4.21 |
| 446 | 300242 | 明家科技 | 11,633,908.22 | 4.20 |
| 447 | 002175 | 东方网络 | 11,571,726.80 | 4.18 |
| 448 | 600420 | 现代制药 | 11,396,015.08 | 4.12 |
| 449 | 600588 | 用友网络 | 11,391,910.00 | 4.12 |
| 450 | 002139 | 拓邦股份 | 11,100,762.22 | 4.01 |
| 451 | 002465 | 海格通信 | 11,078,008.66 | 4.00 |
| 452 | 300206 | 理邦仪器 | 10,864,908.26 | 3.93 |
| 453 | 600584 | 长电科技 | 10,043,036.00 | 3.63 |
| 454 | 600741 | 华域汽车 | 9,982,170.30  | 3.61 |
| 455 | 002433 | 太安堂  | 9,315,616.93  | 3.37 |
| 456 | 002309 | 中利科技 | 9,296,531.93  | 3.36 |
| 457 | 300296 | 利亚德  | 9,235,003.99  | 3.34 |
| 458 | 002586 | 围海股份 | 8,933,196.64  | 3.23 |
| 459 | 300270 | 中威电子 | 8,914,929.94  | 3.22 |
| 460 | 603019 | 中科曙光 | 8,855,735.00  | 3.20 |
| 461 | 600826 | 兰生股份 | 8,687,941.94  | 3.14 |
| 462 | 000939 | 凯迪生态 | 8,660,222.54  | 3.13 |
| 463 | 300446 | 乐凯新材 | 8,640,639.30  | 3.12 |
| 464 | 300331 | 苏大维格 | 8,227,391.00  | 2.97 |
| 465 | 601607 | 上海医药 | 8,000,052.43  | 2.89 |
| 466 | 002063 | 远光软件 | 7,804,363.80  | 2.82 |
| 467 | 300298 | 三诺生物 | 7,735,089.17  | 2.79 |
| 468 | 300369 | 绿盟科技 | 7,655,940.78  | 2.77 |
| 469 | 300037 | 新宙邦  | 7,548,588.28  | 2.73 |
| 470 | 300290 | 荣科科技 | 7,505,424.86  | 2.71 |
| 471 | 600005 | 武钢股份 | 7,481,479.24  | 2.70 |
| 472 | 600060 | 海信电器 | 7,477,389.58  | 2.70 |



|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 473 | 600135 | 乐凯胶片   | 7,475,671.09 | 2.70 |
| 474 | 300232 | 洲明科技   | 7,437,484.27 | 2.69 |
| 475 | 300199 | 翰宇药业   | 7,436,834.35 | 2.69 |
| 476 | 002364 | 中恒电气   | 7,340,351.68 | 2.65 |
| 477 | 300334 | 津膜科技   | 7,272,093.50 | 2.63 |
| 478 | 601186 | 中国铁建   | 7,250,507.00 | 2.62 |
| 479 | 000002 | 万科 A   | 7,228,655.86 | 2.61 |
| 480 | 000100 | TCL 集团 | 7,212,245.42 | 2.61 |
| 481 | 600809 | 山西汾酒   | 7,160,645.83 | 2.59 |
| 482 | 601668 | 中国建筑   | 7,159,805.00 | 2.59 |
| 483 | 000911 | 南宁糖业   | 7,109,403.65 | 2.57 |
| 484 | 300408 | 三环集团   | 7,050,352.46 | 2.55 |
| 485 | 300376 | 易事特    | 7,025,094.09 | 2.54 |
| 486 | 002018 | 华信国际   | 6,977,234.61 | 2.52 |
| 487 | 000400 | 许继电气   | 6,866,968.48 | 2.48 |
| 488 | 300227 | 光韵达    | 6,690,885.06 | 2.42 |
| 489 | 300070 | 碧水源    | 6,656,642.93 | 2.40 |
| 490 | 600418 | 江淮汽车   | 6,640,650.94 | 2.40 |
| 491 | 300089 | 文化长城   | 6,588,993.64 | 2.38 |
| 492 | 002084 | 海鸥卫浴   | 6,159,283.78 | 2.23 |
| 493 | 600008 | 首创股份   | 6,137,857.09 | 2.22 |
| 494 | 300449 | 汉邦高科   | 6,089,238.54 | 2.20 |
| 495 | 002358 | 森源电气   | 6,047,806.13 | 2.18 |
| 496 | 000069 | 华侨城 A  | 5,877,768.10 | 2.12 |
| 497 | 002469 | 三维工程   | 5,815,670.91 | 2.10 |
| 498 | 600406 | 国电南瑞   | 5,615,435.61 | 2.03 |
| 499 | 600036 | 招商银行   | 5,571,778.73 | 2.01 |

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 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 | 50,641,382,593.94 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 48,217,000,564.55 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

#### 8.5 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。

## 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

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

本基金本报告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

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 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

本基金未投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

## 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

本基金未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

新开普（300248）于 2015 年 7 月 31 日收到中国证券监督管理委员会河南监管局《关于对新开普电子股份有限公司实施出具警示函措施的决定》，因公司违反《上市公司信息披露管理办法》以及《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》，河南证监局对公司采取出具了警示函的监管措施，并记入证券期货诚信档案。同时要求公司董事、监事、高级管理人员应着重加强对信息披露和内幕信息管理相关法律法规的学习，对以上问题提出切实可行的整改措施与计划，并在收到本决定书之日起 30 日内向河南证监局提交书面报告。

德奥通航（002260）于 2015 年 6 月 15 日收到深圳证券交易所《关于对广东伊立浦电器股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》，因公司未及时履行信息披露义务，决定对公司给予通报批评的处分，同时对公司董事长朱家钢、副董事长兼总经理王正年、董事兼副总经理王鑫文、副总经理兼董事会秘书陈国辉、财务总监张之珩给予通报批评的处分，并记入上市公司诚信档案。

本基金管理人通过对上述上市公司进行进一步了解和视为，认为上述处分不会对公司的投资价值构成实质性影响，因此本基金管理人对上述股票的投资判断未发生改变。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余八名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 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   | 7,081,616.89   |
| 2  | 应收证券清算款 | 91,174,476.26  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 144,888.31     |
| 5  | 应收申购款   | 33,395,046.75  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 131,796,028.21 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|---------------|----------|
| 1  | 002612 | 朗姿股份 | 194,033,467.32 | 4.35          | 重大事项停牌   |
| 2  | 300038 | 梅泰诺  | 172,971,943.04 | 3.88          | 重大事项停牌   |

## § 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 159,735      | 11,702.81     | 721,887,606.08 | 38.62%     | 1,147,460,116.22 | 61.38%     |

### 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<br>持有本基金 | 911,675.41 | 0.0488%  |

### 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<br>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                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2013年6月27日）基金份额总额 | 1,449,066,584.71 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 236,737,169.71   |
| 本报告期基金总申购份额               | 4,347,635,361.83 |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 2,715,024,809.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -                |
| 本报告期末基金份额总额               | 1,869,347,722.30 |

注：总申购份额含红利再投和转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。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

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 100,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2013 年 6 月 27 日）起至本报告期末。

### 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

#### 1、报告期内基金管理人受稽查或处罚的情况

因公司原基金经理牟旭东被追究“利用非公开信息交易”刑事责任，上海证监局于 2014 年 11 月对公司进行了专项检查。公司于 2015 年 1 月 23 日收到了上海证监局下发的《沪证监决【2015】18 号-关于华宝兴业基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》。公司已经完成了相关问题的整改，并已向上海证监局上报了专项报告。

#### 2、报告期内，本基金管理人的高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

#### 3、报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

## 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 |    |
| 国信证券 | 1      | 15,469,014,352.00 | 15.65%       | 14,121,220.64 | 15.62%     | -  |
| 国泰君安 | 2      | 13,195,548,222.23 | 13.35%       | 12,059,047.62 | 13.34%     | -  |
| 长江证券 | 1      | 11,875,396,520.61 | 12.01%       | 10,982,597.02 | 12.14%     | -  |
| 海通证券 | 2      | 11,104,579,132.04 | 11.23%       | 10,016,806.47 | 11.08%     | -  |
| 中信证券 | 1      | 10,644,861,298.76 | 10.77%       | 9,839,337.95  | 10.88%     | -  |
| 招商证券 | 1      | 5,476,710,219.81  | 5.54%        | 4,990,923.52  | 5.52%      | -  |
| 华泰联合 | 1      | 4,822,266,631.75  | 4.88%        | 4,437,587.94  | 4.91%      | -  |
| 兴业证券 | 2      | 4,637,552,059.52  | 4.69%        | 4,239,804.90  | 4.69%      | -  |
| 银河证券 | 1      | 4,239,698,415.19  | 4.29%        | 3,840,853.43  | 4.25%      | -  |
| 中信建投 | 2      | 3,807,493,032.16  | 3.85%        | 3,530,518.12  | 3.90%      | -  |
| 东方证券 | 1      | 2,914,741,958.04  | 2.95%        | 2,656,204.71  | 2.94%      | -  |
| 中投证券 | 1      | 2,690,390,559.00  | 2.72%        | 2,436,732.84  | 2.69%      | -  |
| 华创证券 | 1      | 2,481,496,369.20  | 2.51%        | 2,261,387.44  | 2.50%      | -  |
| 上海证券 | 1      | 1,666,832,282.53  | 1.69%        | 1,518,985.35  | 1.68%      | -  |
| 浙商证券 | 1      | 1,529,375,470.19  | 1.55%        | 1,393,718.13  | 1.54%      | -  |
| 民生证券 | 1      | 1,356,839,581.99  | 1.37%        | 1,223,638.43  | 1.35%      | -  |
| 方正证券 | 1      | 487,364,732.58    | 0.49%        | 453,882.21    | 0.50%      | -  |
| 中金国际 | 1      | 458,222,320.89    | 0.46%        | 426,741.30    | 0.47%      | -  |
| 爱建证券 | 1      | -                 | -            | -             | -          | -  |
| 东北证券 | 2      | -                 | -            | -             | -          | -  |
| 东吴证券 | 2      | -                 | -            | -             | -          | -  |

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；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；具备基金运作所需要的高效、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

并能为本基金提供全面的信息服务；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，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期新增的交易单元为海通证券、银河证券、浙商证券、东方证券、上海证券、兴业证券、华创证券、中信建投、方正证券、招商证券、爱建证券、东吴证券、东北证券。

### 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

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易 |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 国泰君安 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰联合 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 兴业证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中投证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 上海证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 浙商证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金国际 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 爱建证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

华宝兴业基金管理有限公司  
2016 年 3 月 28 日