

光大保德信量化核心证券投资基金
2015 年年度报告
2015 年 12 月 31 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 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。

本报告中财务资料已经审计，安永华明会计师事务所为本基金财务出具了 2015 年度无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误！未定义书签。
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 审计报告	错误！未定义书签。
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	73
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	73
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74

8.11 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末上市基金前十名持有人	错误! 未定义书签。
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
§10 开放式基金份额变动	75
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
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	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	78
§12 发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
§13 影响投资者决策的其他重要信息	错误! 未定义书签。
§14 备查文件目录	80
14.1 备查文件目录	80
14.2 存放地点	80
14.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信量化核心证券投资基金
基金简称	光大保德信量化股票
基金主代码	360001
交易代码	360001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 8 月 27 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,522,166,950.02 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。在构建投资组合时综合考虑收益因素及风险因素，并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，即股票/现金等各类资产持有比例保持相对固定。投资品种基准比例：股票 90% 现金 10% 由于持有股票资产的市值波动导致仓位变化，股票持有比例允许在一定范围（上下 5%）内浮动。
业绩比较基准	90% × 沪深 300 指数 + 10% × 同业存款利率
风险收益特征	本基金风险收益特征属于证券投资基金中风险程度中等偏高的品种，按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

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	光大保德信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	魏丹	张建春
	联系电话	021-33074700-3226	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话	4008-202-888, 021-53524620	95595	
传真	021-63351152	010-63639132	
注册地址	上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心	
办公地址	上海市延安东路222号外滩中心46楼	北京市西城区太平桥大街25号	
邮政编码	200002	100045	
法定代表人	林昌	唐双宁	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	3,722,022,174.98	602,123,500.65	626,244,512.48
本期利润	3,638,839,062.55	1,213,162,384.86	1,110,509,928.02
加权平均基金份额本期利润	0.8592	0.1332	0.1047
本期加权平均净值利润率	64.83%	15.17%	12.35%
本期基金份额净值增长率	50.27%	16.91%	13.07%
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	1,913,996,849.88	731,451,465.04	137,295,175.84
期末可供分配基金份额利润	0.7589	0.0934	0.0134
期末基金资产净值	3,875,648,536.34	8,116,652,407.37	9,072,864,632.94
期末基金份额净值	1.5366	1.0369	0.8869
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	451.54%	267.05%	213.95%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	35.51%	1.98%	14.83%	1.51%	20.68%	0.47%
过去六个月	-4.21%	2.97%	-14.68%	2.41%	10.47%	0.56%
过去一年	50.27%	2.56%	5.82%	2.24%	44.45%	0.32%
过去三年	98.64%	1.78%	43.68%	1.61%	54.96%	0.17%
过去五年	69.82%	1.59%	25.97%	1.44%	43.85%	0.15%
自基金合同生效起至今	451.54%	1.77%	242.97%	1.65%	208.57%	0.12%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，

经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

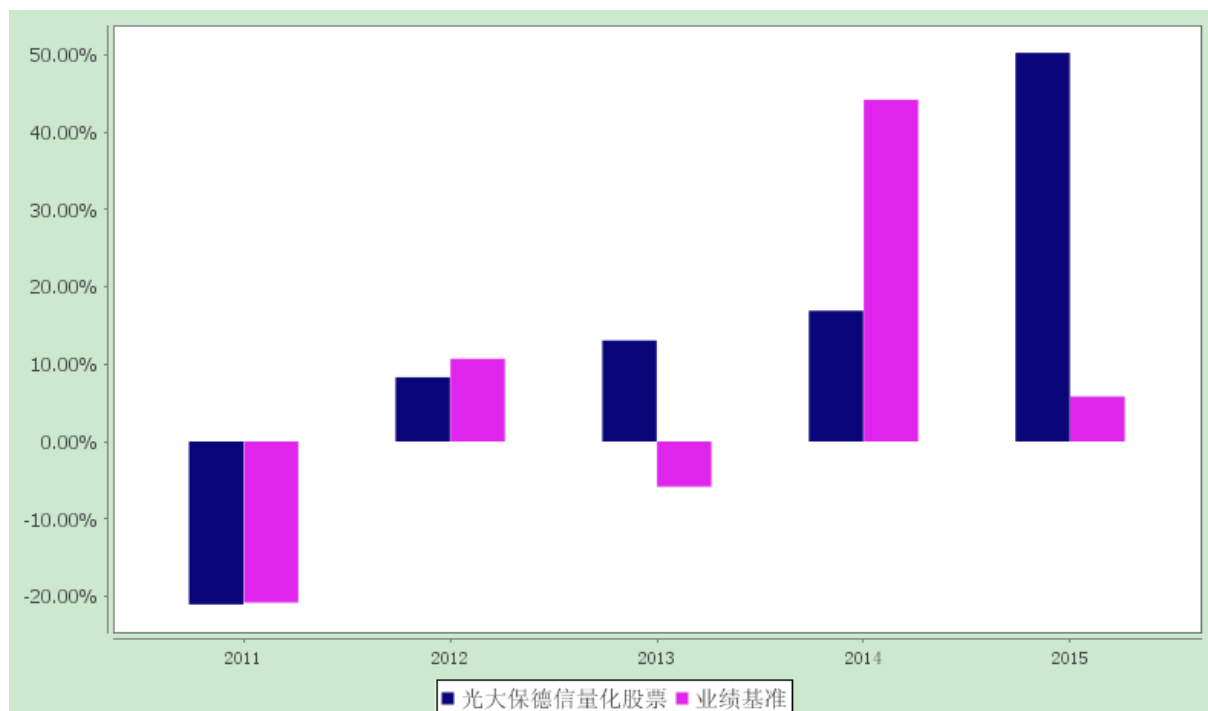
光大保德信量化核心证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2004 年 8 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2004 年 8 月 27 日至 2005 年 2 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信量化核心证券投资基金
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2004 年 8 月 27 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

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
2013	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
2015	0.200	60,503,579.14	53,421,117.42	113,924,696.56	-
合计	0.200	60,503,579.14	53,421,117.42	113,924,696.56	-

§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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2015 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 24 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添盛双月理财债券型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金和光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
田大伟	基金经理	2014-02-25	-	6 年	田大伟先生，CFA、博士，2005 年毕业于上海财经大学金融学专业，获得经济学硕士学位，2010 年毕业于上海财经大学、美国南加州大学（联合培养）金融工程专业，获得经济学博士学位。田大伟先生于 2010 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任金融工程师、策略分析师、首席策略分析师，2013 年 7 月至 2014 年 2 月兼任光大保德信大中华 3 号特定客户资产管理计划的投资经理。现任光大保德信量化核心证券投资基金基金经理，同时兼任首席策略分析师。

注：对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，并建立《投资研究管理制度》及细则、《集中交易管理制度》、《异常交易监控与报告制度》、《投资对象备选库建立与维护管理办法》等制度作为公平交易执行的制度保障。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特定客户资产管理组合在内的所有组合，范围包括股票、债券等所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制，形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括：

事前控制：1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；2、各个投资主体有明确的职责和权限划分，投资组合经理在权限范围内自主决策，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程；建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控：1、主动管理型的基金，严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易，严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易，确有需要进行日内反向交易的，需要进行严格的审批流程；2、交易环节中所有指令严格按照“时间优先、价格优先”的原则执行指令，交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析：对公平交易的事后分析主要集中在对同一投资组合或不同投资组合临近交易日的反向交易和不同投资组合临近交易日的同向交易，同时在每季度和每年度，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，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做

专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析，具体的分析方法如下：第一步，在 A 组合买入或者卖出某只证券的当日（3 日、5 日）内，统计 A 组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价，同时统计 B 组合在同期、同方向交易同一只证券的均价，然后比较两者的均价差异，其中买入溢价率 = (B 组合交易均价/A 组合交易均价-1)，卖出溢价率 = (A 组合交易均价/B 组合交易均价-1)；第二步，将发生的所有交易价差汇总进行 T 检验，置信区间 95%，得到交易价差是否趋近于 0 的判断结果，并计算 A 组合与 B 组合同向交易中占优次数的比例为占优比例，用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到 B 组合对 A 组合溢价金额大小，将所有同向交易溢价金额求和，除以 A 组合平均资产净值来计算对 A 组合净值的影响，称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准：交易价差不趋向于零、样本数大于 30、单位溢价率大于 1%、占优比例不在 45%-55% 之间。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。在同向交易价差分析中，本基金在同日内、3 日内、5 日内同向成交价格不劣于其他投资组合，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场与银行间市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

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

回顾 2015 年，市场风格出现了巨大切换。首先是在 1 季度，包括 4、5 月份以 TMT 行业为代表的中小盘、创业板股票飙涨行情。接着市场在 6 月份，包括 8 月下旬出现快速下跌，银行等权重板块抗跌能力凸显。十一假期以后，市场特别是以计算机、传媒为代表的中小盘股票涨幅明显。在 2015 年这种风格不断切换过程中，本基金凭借对现阶段经济和政策的理解，沿着“存量经济本身自发的机会”以及“政策改革带来的机会”这两条主线主抓结构性机会，适时调整了持仓结构，取得了较好的效果。

站在目前时点，我们对中国股市在今后的表现是有信心的。

股市趋势向上可以分为两个阶段，第一个阶段是由改革预期和流动性的宽裕推动的。第二阶段是上市公司业绩提升推动的。第二阶段又可以细分为两部分，第一部分是经济仍然较差、企业产品需求仍然较弱，但是成本端的改善（如融资成本下降、能源成本下降、减税等），仍然可以使得企业

产品的毛利率回升，从而促使企业业绩向上，股市向上。第二部分是经济企稳回升，企业产品需求端好转导致业绩回升，股市向上。

目前中国股市处于第一阶段和第二阶段的衔接处，容易出现“青黄不接”式的震荡。作为专业投资者，我们还是要认清市场发展的本质，市场发展的大趋势。我们认为：第一阶段的改革预期和流动性的宽裕仍然存在，我们进一步判断第二阶段的衔接不会出现大时段的间隔，但市场制度的完善需要一定的时间，所以我们判断 2016 年的市场会如同猴年一样上串下跳，但底部是不断抬升的。用一句诗来形容就是：“两岸猿声啼不住，轻舟已过万重山”。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 50.27%，业绩比较基准收益率为 5.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进一步，我们上面所说的第二阶段是否会来临，有很多重要的观察指标和逻辑判断。首先，我们认为“宽货币”向“宽信用”或将是即将到来的一大亮点。社会融资成本大致等于贷款加权利率，等于无风险利率加风险溢价。风险溢价的下降是导致社会融资成本的下行的最重要的变量之一。目前随着对我国经济的触底企稳信心的增强，我国的风险溢价下降的空间是巨大的。再者，能源成本下行将成为我国企业盈利回升的重要力量之一。目前我国的经济结构仍然是消耗型经济，以石油价格为代表的能源成本持续维持低位将对企业毛利率的改善作出重要贡献。而供给侧改革、国企改革、互联网+战略等等改革措施都是指向微观企业，乃至宏观经济的“由大变强”。我们对这些变革的成功充满信心。

本基金将力争把握好股票投资的新机遇，找准时机，拿捏好方向，进一步加强对新常态经济下跨行业研究投资的力度，沿着“存量经济本身自发的机会”以及“政策改革带来的机会”这两条主线抓结构性机会，同时在上述研究所积淀的大量数据基础上，借助计算机的强大数据计算、回测、分析能力，不断对组合的结构进行优化调整，为基金份额持有者服务。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。此外，监察稽核部每年实施若干内部审计项目，以风险为导向，对公司重要业务环节提出流程改进建议。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，促使公司规范运作，切实保障基金份额持有人的合法权益。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始均按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分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

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽

核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性，估值委员会中的投研人员比例不超过三分之一。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；投资研究部负责估值政策调整对投资业绩影响的评估；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，2015 年 4 月 21 日本基金每 10 份基金份额派发红利 0.20 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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者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

2015 年度，中国光大银行股份有限公司在光大保德信量化核心证券投资基金的托管过程中，严

格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，依法安全托管了基金的全部资产，对光大保德信量化核心证券投资基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

2015 年度，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、相关实施准则、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规的要求；各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人——光大保德信基金管理有限公司编制的“光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年年度报告”进行了复核，报告中相关财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容是真实、准确和完整的。

§6 审计报告

安永华明（2016）审字第 60467078_B01

光大保德信量化核心证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的光大保德信量化核心证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人光大保德信基金管理有限公司的责任。这种责任包括：

（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
 严盛炜 黎 燕
 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
 2016 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	243,970,919.27	634,001,672.57
结算备付金		4,184,280.01	32,528,294.49

存出保证金		1,938,607.86	2,093,598.27
交易性金融资产	7.4.7.2	3,641,193,892.96	7,508,779,565.78
其中：股票投资		3,641,193,892.96	7,508,779,565.78
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,024,734.75
应收利息	7.4.7.5	60,269.77	154,109.81
应收股利		-	-
应收申购款		380,134.78	191,181.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,891,728,104.65	8,178,773,157.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,921,053.22	30,450,373.38
应付管理人报酬	7.4.10.2	4,976,952.14	10,468,287.30
应付托管费	7.4.10.2	829,492.04	1,744,714.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,948,777.23	19,054,677.18

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	403,293.68	402,697.87
负债合计		16,079,568.31	62,120,750.29
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	922,958,782.17	2,832,275,090.22
未分配利润	7.4.7.10	2,952,689,754.17	5,284,377,317.15
所有者权益合计		3,875,648,536.34	8,116,652,407.37
负债和所有者权益总计		3,891,728,104.65	8,178,773,157.66

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5366 元，基金份额总额 2,522,166,950.02 份。

7.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

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 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		3,808,317,045.97	1,430,042,630.17
1.利息收入		3,973,503.15	4,948,417.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,973,503.15	4,948,417.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,886,568,656.74	813,390,171.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,847,934,820.27	659,621,187.19

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	38,633,836.47	153,768,984.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-83,183,112.43	611,038,884.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	957,998.51	665,157.37
减：二、费用		169,477,983.42	216,880,245.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2	84,413,912.70	120,124,219.54
2. 托管费	7.4.10.2	14,068,985.49	20,020,703.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	70,595,085.23	76,335,322.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	400,000.00	400,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,638,839,062.55	1,213,162,384.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,638,839,062.55	1,213,162,384.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	2,832,275,090.22	5,284,377,317.15	8,116,652,407.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,638,839,062.55	3,638,839,062.55
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）	-1,909,316,308.05	-5,856,601,928.97	-7,765,918,237.02
其中：1.基金申购款	155,784,004.59	373,723,570.94	529,507,575.53
2.基金赎回款	-2,065,100,312.64	-6,230,325,499.91	-8,295,425,812.55
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）	-	-113,924,696.56	-113,924,696.56
五、期末所有者权益（基金净值）	922,958,782.17	2,952,689,754.17	3,875,648,536.34
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,701,557,399.17	5,371,307,233.77	9,072,864,632.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,213,162,384.86	1,213,162,384.86
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）	-869,282,308.95	-1,300,092,301.48	-2,169,374,610.43
其中：1.基金申购款	160,904,636.49	256,052,126.24	416,956,762.73

2.基金赎回款	-1,030,186,945.44	-1,556,144,427.72	-2,586,331,373.16
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,832,275,090.22	5,284,377,317.15	8,116,652,407.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：林昌，主管会计工作负责人：梅雷军，会计机构负责人：王永万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行上市的股票、法律法规及证监会允许基金投资的其他金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85-95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5-15%。本基金的业绩比较基准为 90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。

2007 年 5 月 8 日，本基金管理人光大保德信基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.3618 元。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具

会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(3) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

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。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，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。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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收益/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(3) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(4) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(5) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出, 按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率) 在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的, 则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配的比例按有关规定制定;

(2) 本基金收益分配方式分为两种: 现金分红与红利再投资, 本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;

(3) 在符合基金分配条件的前提下, 基金收益分配每年至少一次, 但若基金成立不满 3 个月, 收益可不分配, 年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成;

(4) 基金当年收益须先弥补上一年度亏损后, 方可进行当年收益分配;

(5) 如果基金投资当期出现净亏损, 则不进行收益分配;

(6) 每一基金份额享有同等收益分配权;

(7) 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担;

(8) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

(9) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本年度本基金无分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定, 自 2015 年 3 月 30 日起, 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私

募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	243,970,919.27	634,001,672.57
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	243,970,919.27	634,001,672.57

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,165,343,165.24	3,641,193,892.96	475,850,727.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,165,343,165.24	3,641,193,892.96	475,850,727.72
项目	上年度末			
	2014 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		6,949,745,725.63	7,508,779,565.78	559,033,840.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,949,745,725.63	7,508,779,565.78	559,033,840.15

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	57,514.37	138,526.75
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,882.90	14,637.80
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.10	3.06
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	872.40	942.20
合计	60,269.77	154,109.81

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,948,777.23	19,054,677.18
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,948,777.23	19,054,677.18

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,293.68	2,697.87
其他	-	-
预提费用	-	-
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
合计	403,293.68	402,697.87

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,827,450,527.93	2,832,275,090.22
本期申购	365,689,082.69	155,784,004.59
本期赎回（以“-”号填列）	-5,670,972,660.60	-2,065,100,312.64
本期末	2,522,166,950.02	922,958,782.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	731,451,465.04	4,552,925,852.11	5,284,377,317.15
本期利润	3,722,022,174.98	-83,183,112.43	3,638,839,062.55
本期基金份额交易产生的变动数	-2,425,552,093.58	-3,431,049,835.39	-5,856,601,928.97
其中：基金申购款	195,502,368.49	178,221,202.45	373,723,570.94
基金赎回款	-2,621,054,462.07	-3,609,271,037.84	-6,230,325,499.91
本期已分配利润	-113,924,696.56	-	-113,924,696.56
本期末	1,913,996,849.88	1,038,692,904.29	2,952,689,754.17

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	3,632,082.62	4,648,159.81
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	286,230.82	263,165.94
其他	55,189.71	37,091.32
合计	3,973,503.15	4,948,417.07

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	25,938,098,537.59	25,903,694,099.03
减：卖出股票成本总额	22,090,163,717.32	25,244,072,911.84
买卖股票差价收入	3,847,934,820.27	659,621,187.19

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	38,633,836.47	153,768,984.33
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	38,633,836.47	153,768,984.33

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	-83,183,112.43	611,038,884.21
——股票投资	-83,183,112.43	611,038,884.21
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	-83,183,112.43	611,038,884.21

7.4.7.19 其他收入

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
基金赎回费收入	927,038.84	568,852.61
基金转换费收入	30,959.67	96,304.76
其他收入-印花税返还	-	-
其他收入-其他	-	-
合计	957,998.51	665,157.37

7.4.7.20 交易费用

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
交易所市场交易费用	70,595,085.23	76,335,322.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	70,595,085.23	76,335,322.44

7.4.7.21 其他费用

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
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	-	-
银行间债券账户维护费	-	-
其他费用	-	-
账户维护费	-	-
其他	-	-
合计	400,000.00	400,000.00

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司（简称“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国光大银行股份有限公司（简称“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（简称“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
光大证券	12,972,898,770.44	29.36%	17,968,240,900.42	36.29%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
光大证券	11,587,546.13	29.15%	808,687.50	41.50%

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	16,032,363.15	36.03%	7,575,994.86	39.76%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	84,413,912.70	120,124,219.54
其中：支付销售机构的客户维护费	17,244,926.77	24,547,889.13

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	14,068,985.49	20,020,703.33
----------------	---------------	---------------

注：：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，由基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	243,970,919.27	3,632,082.62	634,001,672.57	4,648,159.81

7.4.10.6 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期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	利润分配合计	备注
		场内	场外					
-	2015-04-20	2015-04-21	2015-04-21	0.200	60,503,579.14	53,421,117.42	113,924,696.56	-
合计				0.200	60,503,579.14	53,421,117.42	113,924,696.56	-

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000023	深天地A	2015-08-18	重大事项停牌	30.53	-	-	3,500.00	62,685.00	106,855.00	-
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大事项停牌	7.06	2016-03-21	7.77	1,664,216.00	11,828,637.18	11,749,364.96	-
000553	沙隆达A	2015-08-05	重大事项停牌	10.70	-	-	23,874.00	353,151.10	255,451.80	-
000657	中钨高新	2015-08-06	重大事项停牌	16.01	2016-02-25	16.05	29,400.00	396,589.25	470,694.00	-
000712	锦龙股份	2015-12-25	重大事项停牌	29.12	2016-01-04	28.00	232,409.00	8,970,749.82	6,767,750.08	-
000810	创维数字	2015-10-22	重大事项停牌	12.67	2016-01-22	11.41	81,941.00	1,388,579.67	1,038,192.47	-
000829	天音控股	2015-11-09	重大事项停牌	12.22	-	-	580,500.00	5,970,234.00	7,093,710.00	-
00087	新希	2015-08	重大事	18.99	2016-0	17.09	141,147.00	2,390,517.29	2,680,381.53	-

6	望	-17	项停牌		3-02					
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事件停牌	13.00	2016-02-22	11.70	534,400.00	3,670,167.57	6,947,200.00	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事件停牌	16.72	2016-02-22	15.05	307,842.00	4,686,601.44	5,147,118.24	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事件停牌	17.40	-	-	424,170.00	6,798,922.17	7,380,558.00	-
002082	栋梁新材	2015-09-18	重大事件停牌	10.21	2016-03-23	11.23	306,077.00	4,004,057.66	3,125,046.17	-
002143	印纪传媒	2015-12-09	重大事件停牌	40.55	2016-01-05	36.78	294,900.00	7,729,546.14	11,958,195.00	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事件停牌	89.53	2016-02-15	80.58	48,900.00	4,804,810.36	4,378,017.00	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事件停牌	22.68	2016-01-11	20.41	14,500.00	241,541.41	328,860.00	-
002320	海峡股份	2015-06-26	重大事件停牌	27.43	2016-01-07	24.69	206,850.00	3,199,580.44	5,673,895.50	-
002383	合众思壮	2015-12-15	重大事件停牌	40.35	2016-03-17	36.32	292,650.00	8,290,876.79	11,808,427.50	-
002483	润邦股份	2015-09-30	重大事件停牌	11.53	2016-03-11	10.38	437,700.00	4,966,905.41	5,046,681.00	-
002537	海立美达	2015-08-17	重大事件停牌	16.59	2016-02-18	18.25	273,822.00	4,071,358.56	4,542,706.98	-
002542	中化岩土	2015-12-28	重大事件停牌	13.59	-	-	317,266.00	4,420,492.40	4,311,644.94	-
002567	唐人神	2015-11-24	重大事件停牌	12.84	2016-02-25	11.56	404,391.00	4,228,725.87	5,192,380.44	-
002575	群兴玩具	2015-06-01	重大事件停牌	16.56	2016-01-06	15.18	588,771.00	6,669,492.02	9,750,047.76	-
002582	好想你	2015-09-17	重大事件停牌	15.62	2016-02-24	17.18	196,700.00	4,836,574.54	3,072,454.00	-
002698	博实股份	2015-12-28	重大事件停牌	29.33	2016-01-05	26.40	10,344.00	441,646.46	303,389.52	-
002707	众信旅游	2015-11-16	重大事件停牌	52.62	2016-03-15	47.36	124,906.00	4,020,499.10	6,572,553.72	-
300043	互动娱乐	2015-12-17	重大事件停牌	15.80	-	-	75,100.00	913,161.95	1,186,580.00	-
300081	恒信移动	2015-11-26	重大事件停牌	47.84	-	-	144,400.00	3,609,260.32	6,908,096.00	-
300197	铁汉生态	2015-12-30	重大事件停牌	17.11	2016-01-07	15.40	41,800.00	844,240.88	715,198.00	-
300247	乐金健康	2015-11-09	重大事件停牌	20.75	2016-03-22	19.17	452,200.00	5,489,352.28	9,383,150.00	-
300303	远方光	2015-11	重大事	18.67	2016-0	20.54	261,076.00	3,695,538.22	4,874,288.92	-

6	电	-03	项停牌		2-24					
300323	华灿光电	2015-12-29	重大事项停牌	10.18	2016-01-04	9.63	460,200.00	3,269,537.34	4,684,836.00	
300326	凯利泰	2015-09-24	重大事项停牌	21.80	2016-01-22	20.53	193,400.00	4,250,005.00	4,216,120.00	
300349	金卡股份	2015-11-20	重大事项停牌	37.75	-	-	14,050.00	406,012.00	530,387.50	
300431	暴风科技	2015-10-27	重大事项停牌	95.83	-	-	119,195.00	4,522,228.49	11,422,456.85	
600122	宏图高科	2015-12-25	重大事项停牌	19.42	-	-	380,400.00	3,781,179.24	7,387,368.00	
600153	建发股份	2015-06-29	重大事项停牌	17.31	-	-	469,179.00	6,375,752.44	8,121,488.49	
600168	武汉控股	2015-10-01	重大事项停牌	9.68	-	-	71,900.00	731,020.31	695,992.00	
600200	江苏吴中	2015-11-26	重大事项停牌	27.89	2016-03-16	25.10	21,354.00	277,162.25	595,563.06	
600219	南山铝业	2015-09-29	重大事项停牌	6.58	2016-01-25	7.00	16,600.00	127,250.86	109,228.00	
600271	航天信息	2015-10-12	重大事项停牌	55.91	-	-	8,700.00	435,297.01	486,417.00	
600375	华菱星马	2015-11-18	重大事项停牌	7.73	2016-03-23	6.96	632,100.00	6,524,176.39	4,886,133.00	
600389	江山股份	2015-12-28	重大事项停牌	26.49	-	-	168,618.00	3,264,332.35	4,466,690.82	
600429	三元股份	2015-09-21	重大事项停牌	7.29	2016-01-27	7.49	307,100.00	3,160,202.79	2,238,759.00	
600502	安徽水利	2015-10-20	重大事项停牌	13.67	-	-	32,600.00	430,939.43	445,642.00	
600572	康恩贝	2015-12-28	重大事项停牌	13.36	2016-01-04	13.18	5,169.00	50,117.55	69,057.84	
600578	京能电力	2015-11-05	重大事项停牌	6.07	2016-02-24	5.49	47,300.00	351,606.06	287,111.00	
600584	长电科技	2015-11-30	重大事项停牌	22.02	-	-	35,658.00	391,561.45	785,189.16	
600649	城投控股	2015-12-30	重大事项停牌	23.16	2016-01-07	20.84	106,500.00	1,064,143.92	2,466,540.00	
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大事项停牌	9.92	2016-02-01	8.93	32,300.00	363,257.55	320,416.00	
600693	东百集团	2015-12-23	重大事项停牌	13.52	2016-01-07	12.19	366,867.00	4,610,164.04	4,960,041.84	
600729	重庆百货	2015-07-24	重大事项停牌	32.39	2016-01-04	29.90	129,900.00	4,433,511.61	4,207,461.00	
600775	洲际油	2015-09	重大事	7.85	-	-	130,960.00	1,169,281.09	1,028,036.00	

9	气	-21	项停牌							
600851	海欣股份	2015-12-21	重大事项停牌	14.70	2016-01-19	13.23	202,400.00	2,867,298.55	2,975,280.00	-
600859	王府井	2015-12-21	重大事项停牌	27.22	2016-01-04	27.22	308,500.00	8,427,036.75	8,397,370.00	-
600864	哈投股份	2015-10-09	重大事项停牌	10.88	2016-01-14	11.97	245,845.00	3,029,496.52	2,674,793.60	-
600873	梅花生物	2015-12-17	重大事项停牌	9.14	-	-	139,845.00	1,314,513.13	1,278,183.30	-
601058	赛轮金宇	2015-12-28	重大事项停牌	9.00	2016-01-12	8.10	469,313.00	4,419,482.69	4,223,817.00	-
601137	博威合金	2015-12-22	重大事项停牌	24.85	2016-02-29	22.37	244,169.00	3,889,717.75	6,067,599.65	-
601377	兴业证券	2015-12-29	重大事项停牌	11.00	2016-01-07	9.40	725,800.00	8,758,266.39	7,983,800.00	-
601678	滨化股份	2015-12-31	重大事项停牌	8.02	2016-01-05	7.22	166,942.00	1,243,591.73	1,338,874.84	-
603010	万盛股份	2015-12-29	重大事项停牌	55.70	-	-	37,100.00	1,880,989.00	2,066,470.00	-
603828	柯利达	2015-11-11	重大事项停牌	34.80	2016-03-03	31.32	125,890.00	3,196,150.35	4,380,972.00	-
603889	新澳股份	2015-12-01	重大事项停牌	31.55	-	-	157,140.00	3,548,071.45	4,957,767.00	-
600880	博瑞传播	2015-09-17	重大事项停牌	11.37	2016-01-18	8.25	489,200.00	5,857,827.05	5,562,204.00	-
300036	超图软件	2015-10-30	重大事项停牌	43.18	2016-01-15	35.11	356,670.00	9,227,403.89	15,401,010.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

本基金管理人风险管理部门建立了对基金进行风险评估的数量化系统，可以从各个不同的层面对基金所承受的各类风险进行密切跟踪。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于同一发行主体发行的信用类投资品种不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金不投资于债券资产，因此在债券资产投资方面不存在信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

本基金管理人风险管理部门从资产配置、行业配置、个股选择等层面制定相应的流动性指标，设定相应的预警阈值，并通过风险评估系统对这些流动性指标进行持续的监测、评估，根据评估结果及时提出流动性风险管理建议。

本基金管理人通过设定对单一证券的投资比例限制，建立相应的授权审批制度，在保护基金持有人利益最大化的前提下，有效管理基金因在单一证券投资比例过高所带来的个股流动性风险。

本基金管理人通过制定流通受限证券的投资流程及风险处置预案，有效管理基金投资流通受限证券所承受的流动性风险。

本基金管理人通过分析本基金持有人结构、密切跟踪监控基金申购赎回趋势，有效预测本基金的流动性需求。同时，本基金管理人通过进行基金变现能力测试得出基金在各市场情形下的变现能力，通过情景分析及压力测试，评估基金在极端情形下面临的流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险及其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	243,970,919.27	-	-	-	-	-	243,970,919.27
结算备付金	4,184,280.01	-	-	-	-	-	4,184,280.01
存出保证金	1,938,607.86	-	-	-	-	-	1,938,607.86
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	3,641,193,892.96	3,641,193,892.96

应收利息	-	-	-	-	-	60,269.77	60,269.77
应收申购款	-	-	-	-	-	380,134.78	380,134.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	250,093,807.14	0.00	0.00	0.00	0.00	3,641,634,297.51	3,891,728,104.65
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,921,053.22	7,921,053.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,976,952.14	4,976,952.14
应付托管费	-	-	-	-	-	829,492.04	829,492.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,948,777.23	1,948,777.23
其他负债	-	-	-	-	-	403,293.68	403,293.68
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	16,079,568.31	16,079,568.31
利率敏感度缺口	250,093,807.14	0.00	0.00	0.00	0.00	3,625,554,729.20	3,875,648,536.34
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	634,001,672.57	-	-	-	-	-	634,001,672.57
结算备付金	32,528,294.49	-	-	-	-	-	32,528,294.49
存出保证金	2,093,598.27	-	-	-	-	-	2,093,598.27
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,508,779,565.78	7,508,779,565.78
应收利息	-	-	-	-	-	154,109.81	154,109.81
应收申购款	-	-	-	-	-	191,181.99	191,181.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,024,734.75	1,024,734.75
资产总计	668,623,565.33	-	-	-	-	7,510,149,592.33	8,178,773,157.66
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	30,450,373.38	30,450,373.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,468,287.30	10,468,287.30
应付托管费	-	-	-	-	-	1,744,714.56	1,744,714.56
应付交易费用	-	-	-	-	-	19,054,677.18	19,054,677.18
其他负债	-	-	-	-	-	402,697.87	402,697.87
负债总计	-	-	-	-	-	62,120,750.29	62,120,750.29
利率敏感度	668,623,565.33	-	-	-	-	7,448,028,842.04	8,116,652,407.37

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券，因此无重大利率风险。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,641,193,892.96	93.95	7,508,779,565.78	92.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	3,641,193,892.96	93.95	7,508,779,565.78	92.51

注：本基金管理人风险管理部门通过监控基金的大类资产配置比例，行业及个股集中度，行业配置相对业绩基准的偏离度，重仓行业及个股的业绩表现，研究深度等，评估并有效管理基金面临的市场价格风险。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 3,925	增加约 6,393
	业绩比较基准下降 1%	减少约 3,925	减少约 6,393

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 3,360,705,927.88 元，属于第二层次的余额为人民币 280,487,965.08 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元（于 2014 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 7,026,066,583.16 元，属于第二层次的余额为人民币 482,712,982.62 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，

确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定，自 2015 年 3 月 30 日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层次转入第二层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 25 日经本基金的基金管理人批准。

§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	3,641,193,892.96	93.56
	其中：股票	3,641,193,892.96	93.56
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	248,155,199.28	6.38
7	其他各项资产	2,379,012.41	0.06
8	合计	3,891,728,104.65	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,821,364.81	0.33
B	采矿业	61,279,831.52	1.58
C	制造业	1,908,179,445.07	49.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	90,359,721.65	2.33
E	建筑业	109,689,653.48	2.83
F	批发和零售业	213,242,531.66	5.50
G	交通运输、仓储和邮政业	69,142,559.63	1.78
H	住宿和餐饮业	3,847,598.40	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	350,614,644.58	9.05
J	金融业	415,520,888.78	10.72
K	房地产业	184,593,539.67	4.76
L	租赁和商务服务业	50,438,701.24	1.30
M	科学研究和技术服务业	18,572,309.30	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	40,504,343.84	1.05

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,349,751.99	0.42
Q	卫生和社会工作	1,675,914.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	51,464,989.40	1.33
S	综合	42,896,103.94	1.11
	合计	3,641,193,892.96	93.95

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	1,508,900	54,320,400.00	1.40
2	000001	平安银行	3,205,580	38,434,904.20	0.99
3	600036	招商银行	2,034,466	36,600,043.34	0.94
4	601166	兴业银行	1,936,400	33,054,348.00	0.85
5	601988	中国银行	7,265,700	29,135,457.00	0.75
6	000686	东北证券	1,325,286	23,192,505.00	0.60
7	000166	申万宏源	1,999,964	21,419,614.44	0.55
8	000750	国海证券	1,420,373	18,251,793.05	0.47
9	300059	东方财富	339,963	17,688,274.89	0.46
10	601939	建设银行	3,059,640	17,684,719.20	0.46
11	300245	天玑科技	406,500	17,085,195.00	0.44
12	000881	大连国际	865,093	16,782,804.20	0.43
13	601009	南京银行	925,732	16,385,456.40	0.42
14	600661	新南洋	423,459	16,349,751.99	0.42
15	600104	上汽集团	766,089	16,256,408.58	0.42
16	002279	久其软件	237,525	16,080,442.50	0.41
17	300036	超图软件	356,670	15,401,010.60	0.40
18	002148	北纬通信	669,026	15,260,483.06	0.39
19	002063	远光软件	678,328	14,339,853.92	0.37
20	600015	华夏银行	1,177,086	14,289,824.04	0.37
21	300033	同花顺	186,068	13,220,131.40	0.34
22	600325	华发股份	809,633	13,197,017.90	0.34
23	300230	永利股份	339,200	12,675,904.00	0.33
24	002662	京威股份	553,807	12,183,754.00	0.31
25	000501	鄂武商 A	567,245	12,139,043.00	0.31
26	002143	印纪传媒	294,900	11,958,195.00	0.31
27	002383	合众思壮	292,650	11,808,427.50	0.30
28	000426	兴业矿业	1,664,216	11,749,364.96	0.30

29	300229	拓尔思	372,498	11,696,437.20	0.30
30	002407	多氟多	152,300	11,614,398.00	0.30
31	300075	数字政通	368,085	11,539,464.75	0.30
32	300068	南都电源	581,194	11,530,888.96	0.30
33	300431	暴风科技	119,195	11,422,456.85	0.29
34	300079	数码视讯	936,706	11,352,876.72	0.29
35	601169	北京银行	1,072,011	11,288,275.83	0.29
36	002482	广田股份	380,328	11,124,594.00	0.29
37	600016	民生银行	1,141,786	11,006,817.04	0.28
38	002421	达实智能	500,200	10,954,380.00	0.28
39	002402	和而泰	383,800	10,896,082.00	0.28
40	300130	新国都	288,346	10,746,655.42	0.28
41	601929	吉视传媒	1,717,848	10,616,300.64	0.27
42	002380	科远股份	264,472	10,602,682.48	0.27
43	000851	高鸿股份	647,300	10,117,299.00	0.26
44	600048	保利地产	935,330	9,951,911.20	0.26
45	002142	宁波银行	641,149	9,944,220.99	0.26
46	000042	中洲控股	473,678	9,904,606.98	0.26
47	300327	中颖电子	247,321	9,818,643.70	0.25
48	300265	通光线缆	629,536	9,789,284.80	0.25
49	002575	群兴玩具	588,771	9,750,047.76	0.25
50	603598	引力传媒	141,040	9,709,193.60	0.25
51	601677	明泰铝业	606,266	9,700,256.00	0.25
52	000786	北新建材	814,800	9,696,120.00	0.25
53	002601	佰利联	248,141	9,667,573.36	0.25
54	601099	太平洋	980,100	9,624,582.00	0.25
55	300302	同有科技	132,000	9,563,400.00	0.25
56	002310	东方园林	360,755	9,545,577.30	0.25
57	002454	松芝股份	493,751	9,475,081.69	0.24
58	600756	浪潮软件	182,700	9,396,261.00	0.24
59	300247	乐金健康	452,200	9,383,150.00	0.24
60	603001	奥康国际	277,034	9,313,883.08	0.24
61	000926	福星股份	552,050	9,296,522.00	0.24
62	300118	东方日升	634,051	9,238,123.07	0.24
63	002618	丹邦科技	189,400	9,216,204.00	0.24
64	300435	中泰股份	120,201	9,200,184.54	0.24
65	601233	桐昆股份	695,688	9,148,297.20	0.24
66	002335	科华恒盛	188,900	9,067,200.00	0.23
67	600651	飞乐音响	608,306	8,972,513.50	0.23
68	300379	东方通	72,600	8,907,294.00	0.23
69	000778	新兴铸管	1,347,675	8,746,410.75	0.23
70	002496	辉丰股份	308,475	8,729,842.50	0.23
71	002516	旷达科技	603,743	8,693,899.20	0.22
72	002281	光迅科技	133,410	8,648,970.30	0.22

73	300221	银禧科技	648,500	8,631,535.00	0.22
74	002309	中利科技	458,643	8,613,315.54	0.22
75	600011	华能国际	969,901	8,467,235.73	0.22
76	300142	沃森生物	639,320	8,426,237.60	0.22
77	600260	凯乐科技	563,487	8,418,495.78	0.22
78	000623	吉林敖东	271,578	8,405,339.10	0.22
79	600859	王府井	308,500	8,397,370.00	0.22
80	600114	东睦股份	514,260	8,310,441.60	0.21
81	002673	西部证券	250,132	8,231,844.12	0.21
82	002343	禾欣股份	135,500	8,224,850.00	0.21
83	600185	格力地产	384,392	8,164,486.08	0.21
84	600153	建发股份	469,179	8,121,488.49	0.21
85	600525	长园集团	427,190	8,043,987.70	0.21
86	600405	动力源	480,128	8,037,342.72	0.21
87	601377	兴业证券	725,800	7,983,800.00	0.21
88	600837	海通证券	502,601	7,951,147.82	0.21
89	300373	扬杰科技	365,850	7,847,482.50	0.20
90	000530	大冷股份	413,207	7,842,668.86	0.20
91	300098	高新兴	372,880	7,826,751.20	0.20
92	300389	艾比森	159,601	7,822,045.01	0.20
93	000039	中集集团	370,608	7,782,768.00	0.20
94	300178	腾邦国际	263,600	7,670,760.00	0.20
95	300471	厚普股份	102,760	7,665,896.00	0.20
96	300364	中文在线	42,945	7,644,210.00	0.20
97	600657	信达地产	1,095,219	7,611,772.05	0.20
98	600648	外高桥	289,422	7,603,115.94	0.20
99	600366	宁波韵升	346,900	7,576,296.00	0.20
100	300002	神州泰岳	576,638	7,553,957.80	0.19
101	600004	白云机场	523,694	7,452,165.62	0.19
102	300418	昆仑万维	181,422	7,420,159.80	0.19
103	002467	二六三	353,346	7,416,732.54	0.19
104	600122	宏图高科	380,400	7,387,368.00	0.19
105	002048	宁波华翔	424,170	7,380,558.00	0.19
106	300047	天源迪科	252,400	7,344,840.00	0.19
107	002469	三维工程	454,162	7,334,716.30	0.19
108	002416	爱施德	417,599	7,307,982.50	0.19
109	000090	天健集团	427,683	7,279,164.66	0.19
110	300196	长海股份	203,638	7,247,476.42	0.19
111	002614	蒙发利	370,600	7,185,934.00	0.19
112	600999	招商证券	330,600	7,174,020.00	0.19
113	002557	洽洽食品	380,507	7,123,091.04	0.18
114	300286	安科瑞	207,000	7,120,800.00	0.18
115	300065	海兰信	186,202	7,112,916.40	0.18
116	601668	中国建筑	1,121,639	7,111,191.26	0.18

117	000829	天音控股	580,500	7,093,710.00	0.18
118	300231	银信科技	262,100	7,045,248.00	0.18
119	300259	新天科技	544,021	7,012,430.69	0.18
120	000973	佛塑科技	534,400	6,947,200.00	0.18
121	002706	良信电器	117,452	6,929,668.00	0.18
122	300301	长方照明	643,362	6,909,707.88	0.18
123	300081	恒信移动	144,400	6,908,096.00	0.18
124	002553	南方轴承	479,800	6,817,958.00	0.18
125	002208	合肥城建	276,899	6,784,025.50	0.18
126	000712	锦龙股份	232,409	6,767,750.08	0.17
127	000703	恒逸石化	608,514	6,760,590.54	0.17
128	002315	焦点科技	70,317	6,751,135.17	0.17
129	000612	焦作万方	877,828	6,697,827.64	0.17
130	300017	网宿科技	111,379	6,681,626.21	0.17
131	300100	双林股份	212,689	6,661,419.48	0.17
132	002500	山西证券	433,600	6,608,064.00	0.17
133	002588	史丹利	202,905	6,600,499.65	0.17
134	002733	雄韬股份	215,575	6,598,750.75	0.17
135	002707	众信旅游	124,906	6,572,553.72	0.17
136	000685	中山公用	461,478	6,529,913.70	0.17
137	002626	金达威	333,800	6,479,058.00	0.17
138	002599	盛通股份	158,072	6,439,853.28	0.17
139	002747	埃斯顿	89,790	6,391,252.20	0.16
140	300358	楚天科技	167,685	6,390,475.35	0.16
141	002405	四维图新	164,635	6,387,838.00	0.16
142	300356	光一科技	112,907	6,334,082.70	0.16
143	300339	润和软件	131,700	6,324,234.00	0.16
144	300077	国民技术	139,600	6,307,128.00	0.16
145	000701	厦门信达	254,754	6,266,948.40	0.16
146	002283	天润曲轴	280,400	6,258,528.00	0.16
147	300476	胜宏科技	112,600	6,205,386.00	0.16
148	002560	通达股份	141,890	6,172,215.00	0.16
149	300073	当升科技	157,430	6,113,006.90	0.16
150	600086	东方金钰	495,100	6,094,681.00	0.16
151	601137	博威合金	244,169	6,067,599.65	0.16
152	300325	德威新材	291,066	6,057,083.46	0.16
153	002091	江苏国泰	226,626	6,021,452.82	0.16
154	000078	海王生物	250,500	6,001,980.00	0.15
155	300371	汇中股份	164,322	5,996,109.78	0.15
156	002517	泰亚股份	99,000	5,993,460.00	0.15
157	300193	佳士科技	446,920	5,948,505.20	0.15
158	002394	联发股份	315,979	5,886,688.77	0.15
159	300201	海伦哲	293,500	5,878,805.00	0.15
160	600252	中恒集团	798,219	5,858,927.46	0.15

161	600563	法拉电子	140,774	5,857,606.14	0.15
162	300209	天泽信息	225,723	5,823,653.40	0.15
163	300271	华宇软件	122,500	5,816,300.00	0.15
164	600060	海信电器	295,579	5,814,038.93	0.15
165	300217	东方电热	349,774	5,809,746.14	0.15
166	000802	北京文化	171,100	5,796,868.00	0.15
167	300151	昌红科技	262,500	5,751,375.00	0.15
168	002225	濮耐股份	751,690	5,750,428.50	0.15
169	002191	劲嘉股份	369,700	5,678,592.00	0.15
170	002437	誉衡药业	187,700	5,677,925.00	0.15
171	002320	海峡股份	206,850	5,673,895.50	0.15
172	600383	金地集团	410,974	5,671,441.20	0.15
173	002573	清新环境	252,700	5,670,588.00	0.15
174	002726	龙大肉食	371,400	5,641,566.00	0.15
175	002668	奥马电器	67,374	5,612,254.20	0.14
176	000572	海马汽车	874,500	5,596,800.00	0.14
177	600005	武钢股份	1,610,800	5,589,476.00	0.14
178	600880	博瑞传播	489,200	5,562,204.00	0.14
179	002491	通鼎互联	286,600	5,554,308.00	0.14
180	002101	广东鸿图	167,506	5,527,698.00	0.14
181	603008	喜临门	221,344	5,511,465.60	0.14
182	300382	斯莱克	115,444	5,477,817.80	0.14
183	002028	思源电气	344,658	5,476,615.62	0.14
184	002014	永新股份	277,686	5,453,753.04	0.14
185	300103	达刚路机	204,500	5,437,655.00	0.14
186	002419	天虹商场	402,575	5,434,762.50	0.14
187	600761	安徽合力	406,492	5,426,668.20	0.14
188	601012	隆基股份	397,000	5,419,050.00	0.14
189	002016	世荣兆业	399,800	5,409,294.00	0.14
190	002382	蓝帆医疗	192,800	5,390,688.00	0.14
191	600062	华润双鹤	234,852	5,356,974.12	0.14
192	002211	宏达新材	418,507	5,356,889.60	0.14
193	002145	中核钛白	345,800	5,290,740.00	0.14
194	600066	宇通客车	235,152	5,288,568.48	0.14
195	300018	中元华电	149,500	5,287,815.00	0.14
196	600141	兴发集团	360,061	5,264,091.82	0.14
197	300253	卫宁软件	125,612	5,260,630.56	0.14
198	300035	中科电气	326,500	5,256,650.00	0.14
199	000823	超声电子	450,783	5,251,621.95	0.14
200	000963	华东医药	64,062	5,250,521.52	0.14
201	600894	广日股份	262,624	5,249,853.76	0.14
202	300095	华伍股份	345,900	5,247,303.00	0.14
203	600230	沧州大化	337,943	5,241,495.93	0.14
204	300338	开元仪器	285,800	5,230,140.00	0.13

205	300177	中海达	272,655	5,229,522.90	0.13
206	300208	恒顺众昇	214,600	5,214,780.00	0.13
207	601328	交通银行	809,100	5,210,604.00	0.13
208	300121	阳谷华泰	323,378	5,206,385.80	0.13
209	002567	唐人神	404,391	5,192,380.44	0.13
210	002576	通达动力	164,427	5,177,806.23	0.13
211	600238	海南椰岛	319,990	5,177,438.20	0.13
212	000961	中南建设	334,800	5,176,008.00	0.13
213	002738	中矿资源	145,200	5,154,600.00	0.13
214	002011	盾安环境	307,842	5,147,118.24	0.13
215	300305	裕兴股份	158,200	5,141,500.00	0.13
216	300295	三六五网	103,482	5,132,707.20	0.13
217	002708	光洋股份	325,500	5,110,350.00	0.13
218	600360	华微电子	525,100	5,109,223.00	0.13
219	600105	永鼎股份	221,300	5,092,113.00	0.13
220	002550	千红制药	230,200	5,087,420.00	0.13
221	600884	杉杉股份	129,321	5,074,556.04	0.13
222	600223	鲁商置业	551,828	5,071,299.32	0.13
223	000933	神火股份	1,016,893	5,064,127.14	0.13
224	601998	中信银行	700,000	5,054,000.00	0.13
225	002483	润邦股份	437,700	5,046,681.00	0.13
226	000488	晨鸣纸业	565,600	5,045,152.00	0.13
227	300056	三维丝	233,800	5,043,066.00	0.13
228	002233	塔牌集团	343,754	5,035,996.10	0.13
229	000409	山东地矿	391,935	5,024,606.70	0.13
230	600039	四川路桥	983,400	5,015,340.00	0.13
231	600498	烽火通信	175,565	5,005,358.15	0.13
232	002004	华邦健康	353,472	5,001,628.80	0.13
233	300243	瑞丰高材	245,800	4,989,740.00	0.13
234	002565	上海绿新	417,275	4,986,436.25	0.13
235	000716	黑芝麻	292,614	4,980,290.28	0.13
236	600143	金发科技	578,900	4,978,540.00	0.13
237	000333	美的集团	151,430	4,969,932.60	0.13
238	600976	健民集团	146,859	4,968,239.97	0.13
239	600693	东百集团	366,867	4,960,041.84	0.13
240	603889	新澳股份	157,140	4,957,767.00	0.13
241	601633	长城汽车	411,021	4,948,692.84	0.13
242	002492	恒基达鑫	304,800	4,937,760.00	0.13
243	300310	宜通世纪	79,212	4,937,283.96	0.13
244	600697	欧亚集团	118,660	4,917,270.40	0.13
245	002630	华西能源	332,689	4,913,816.53	0.13
246	300165	天瑞仪器	187,800	4,905,336.00	0.13
247	002126	银轮股份	264,896	4,887,331.20	0.13
248	600375	华菱星马	632,100	4,886,133.00	0.13

249	600199	金种子酒	485,910	4,878,536.40	0.13
250	300306	远方光电	261,076	4,874,288.92	0.13
251	000997	新大陆	191,800	4,856,376.00	0.13
252	000900	现代投资	578,659	4,854,949.01	0.13
253	002321	华英农业	367,319	4,852,283.99	0.13
254	600216	浙江医药	391,300	4,840,381.00	0.12
255	600467	好当家	454,711	4,829,030.82	0.12
256	002677	浙江美大	220,699	4,815,652.18	0.12
257	002466	天齐锂业	34,200	4,813,650.00	0.12
258	300320	海达股份	316,420	4,803,255.60	0.12
259	000046	泛海控股	382,667	4,802,470.85	0.12
260	600790	轻纺城	589,170	4,789,952.10	0.12
261	002332	仙琚制药	316,100	4,788,915.00	0.12
262	300044	赛为智能	175,300	4,783,937.00	0.12
263	600261	阳光照明	543,850	4,780,441.50	0.12
264	002068	黑猫股份	546,502	4,776,427.48	0.12
265	300176	鸿特精密	162,919	4,752,347.23	0.12
266	600801	华新水泥	583,012	4,751,547.80	0.12
267	600643	爱建集团	323,647	4,741,428.55	0.12
268	000043	中航地产	394,100	4,741,023.00	0.12
269	600552	方兴科技	209,300	4,736,459.00	0.12
270	002168	深圳惠程	398,844	4,718,324.52	0.12
271	000729	燕京啤酒	572,548	4,712,070.04	0.12
272	000700	模塑科技	194,100	4,710,807.00	0.12
273	002404	嘉欣丝绸	436,100	4,705,519.00	0.12
274	002244	滨江集团	590,100	4,697,196.00	0.12
275	002406	远东传动	371,300	4,693,232.00	0.12
276	300323	华灿光电	460,200	4,684,836.00	0.12
277	600723	首商股份	421,481	4,682,653.91	0.12
278	300395	菲利华	95,700	4,679,730.00	0.12
279	002431	棕榈园林	174,300	4,678,212.00	0.12
280	600850	华东电脑	90,403	4,669,314.95	0.12
281	000860	顺鑫农业	218,540	4,654,902.00	0.12
282	600335	国机汽车	248,279	4,652,748.46	0.12
283	600380	健康元	336,297	4,647,624.54	0.12
284	601222	林洋电子	126,376	4,641,790.48	0.12
285	601700	风范股份	463,797	4,633,332.03	0.12
286	603002	宏昌电子	598,263	4,600,642.47	0.12
287	300154	瑞凌股份	333,360	4,600,368.00	0.12
288	600470	六国化工	403,400	4,586,658.00	0.12
289	601398	工商银行	1,000,000	4,580,000.00	0.12
290	000026	飞亚达 A	278,620	4,563,795.60	0.12
291	002490	山东墨龙	398,683	4,560,933.52	0.12
292	000888	峨眉山 A	307,800	4,558,518.00	0.12

293	002317	众生药业	344,058	4,555,327.92	0.12
294	002674	兴业科技	229,424	4,554,066.40	0.12
295	000036	华联控股	507,600	4,553,172.00	0.12
296	002537	海立美达	273,822	4,542,706.98	0.12
297	300232	洲明科技	116,047	4,540,919.11	0.12
298	600561	江西长运	283,400	4,537,234.00	0.12
299	600115	东方航空	595,984	4,535,438.24	0.12
300	002649	博彦科技	80,200	4,513,656.00	0.12
301	600020	中原高速	658,140	4,501,677.60	0.12
302	000978	桂林旅游	317,601	4,500,406.17	0.12
303	002396	星网锐捷	185,500	4,479,825.00	0.12
304	600389	江山股份	168,618	4,466,690.82	0.12
305	002050	三花股份	418,900	4,461,285.00	0.12
306	601908	京运通	542,530	4,459,596.60	0.12
307	002012	凯恩股份	453,200	4,459,488.00	0.12
308	300163	先锋新材	354,400	4,458,352.00	0.12
309	000818	方大化工	472,919	4,445,438.60	0.11
310	002062	宏润建设	456,701	4,429,999.70	0.11
311	600246	万通地产	582,727	4,428,725.20	0.11
312	600665	天地源	574,800	4,420,212.00	0.11
313	000593	大通燃气	307,702	4,409,369.66	0.11
314	600129	太极集团	206,157	4,397,328.81	0.11
315	600582	天地科技	643,600	4,395,788.00	0.11
316	000733	振华科技	175,484	4,387,100.00	0.11
317	603828	柯利达	125,890	4,380,972.00	0.11
318	601567	三星医疗	288,750	4,380,337.50	0.11
319	002174	游族网络	48,900	4,378,017.00	0.11
320	000551	创元科技	330,750	4,372,515.00	0.11
321	300307	慈星股份	271,899	4,366,697.94	0.11
322	000681	视觉中国	114,790	4,363,167.90	0.11
323	300386	飞天诚信	88,000	4,351,600.00	0.11
324	600694	大商股份	84,100	4,342,083.00	0.11
325	601258	庞大集团	1,105,642	4,334,116.64	0.11
326	600805	悦达投资	342,155	4,331,682.30	0.11
327	600785	新华百货	141,500	4,331,315.00	0.11
328	002128	露天煤业	512,217	4,328,233.65	0.11
329	300283	温州宏丰	300,103	4,321,483.20	0.11
330	000619	海螺型材	288,009	4,320,135.00	0.11
331	600477	杭萧钢构	350,980	4,317,054.00	0.11
332	002542	中化岩土	317,266	4,311,644.94	0.11
333	002564	天沃科技	353,395	4,304,351.10	0.11
334	600803	新奥股份	271,213	4,301,438.18	0.11
335	601886	江河创建	340,973	4,299,669.53	0.11
336	300138	晨光生物	201,537	4,294,753.47	0.11

337	600883	博闻科技	238,100	4,292,943.00	0.11
338	000030	富奥股份	420,719	4,291,333.80	0.11
339	002408	齐翔腾达	321,385	4,277,634.35	0.11
340	600323	瀚蓝环境	266,400	4,275,720.00	0.11
341	300214	日科化学	391,800	4,274,538.00	0.11
342	002695	煌上煌	114,898	4,273,056.62	0.11
343	002597	金禾实业	388,051	4,268,561.00	0.11
344	300210	森远股份	232,593	4,258,777.83	0.11
345	300150	世纪瑞尔	292,500	4,241,250.00	0.11
346	002449	国星光电	250,523	4,233,838.70	0.11
347	600739	辽宁成大	186,910	4,224,166.00	0.11
348	601058	赛轮金宇	469,313	4,223,817.00	0.11
349	002305	南国置业	660,700	4,221,873.00	0.11
350	300326	凯利泰	193,400	4,216,120.00	0.11
351	600729	重庆百货	129,900	4,207,461.00	0.11
352	002099	海翔药业	176,400	4,207,140.00	0.11
353	300282	汇冠股份	127,615	4,202,361.95	0.11
354	002003	伟星股份	237,122	4,201,801.84	0.11
355	600496	精工钢构	698,647	4,198,868.47	0.11
356	600337	美克家居	268,600	4,195,532.00	0.11
357	002107	沃华医药	161,369	4,184,298.17	0.11
358	603456	九洲药业	58,800	4,181,268.00	0.11
359	300464	星徽精密	80,900	4,177,676.00	0.11
360	600858	银座股份	377,341	4,173,391.46	0.11
361	002157	正邦科技	207,600	4,172,760.00	0.11
362	002054	德美化工	295,704	4,169,426.40	0.11
363	000006	深振业 A	362,000	4,166,620.00	0.11
364	000828	东莞控股	327,800	4,163,060.00	0.11
365	002585	双星新材	319,180	4,162,107.20	0.11
366	600077	宋都股份	572,500	4,162,075.00	0.11
367	000531	穗恒运 A	337,000	4,161,950.00	0.11
368	601898	中煤能源	683,500	4,135,175.00	0.11
369	002403	爱仕达	259,310	4,130,808.30	0.11
370	300346	南大光电	111,400	4,130,712.00	0.11
371	002578	闽发铝业	406,370	4,128,719.20	0.11
372	300388	国祯环保	134,500	4,125,115.00	0.11
373	000301	东方市场	640,000	4,115,200.00	0.11
374	300341	麦迪电气	150,101	4,114,268.41	0.11
375	000656	金科股份	776,701	4,100,981.28	0.11
376	300262	巴安水务	220,782	4,099,921.74	0.11
377	600051	宁波联合	308,881	4,089,584.44	0.11
378	002250	联化科技	216,571	4,086,694.77	0.11
379	300258	精锻科技	228,378	4,076,547.30	0.11
380	000826	启迪桑德	102,815	4,073,530.30	0.11

381	600249	两面针	438,300	4,071,807.00	0.11
382	300107	建新股份	504,875	4,069,292.50	0.10
383	300298	三诺生物	113,011	4,063,875.56	0.10
384	600222	太龙药业	428,900	4,035,949.00	0.10
385	300139	晓程科技	223,860	4,022,764.20	0.10
386	002238	天威视讯	180,710	4,011,762.00	0.10
387	002083	孚日股份	501,450	4,011,600.00	0.10
388	300041	回天新材	150,200	4,010,340.00	0.10
389	600064	南京高科	211,600	4,009,820.00	0.10
390	002033	丽江旅游	227,712	4,007,731.20	0.10
391	600987	航民股份	305,037	4,002,085.44	0.10
392	600382	广东明珠	251,700	3,991,962.00	0.10
393	002552	宝鼎重工	236,400	3,980,976.00	0.10
394	002374	丽鹏股份	235,100	3,973,190.00	0.10
395	601339	百隆东方	527,600	3,972,828.00	0.10
396	000983	西山煤电	653,200	3,971,456.00	0.10
397	002334	英威腾	349,400	3,951,714.00	0.10
398	600641	万业企业	250,189	3,950,484.31	0.10
399	000045	深纺织 A	279,723	3,946,891.53	0.10
400	603808	歌力思	80,500	3,945,305.00	0.10
401	002541	鸿路钢构	195,100	3,941,020.00	0.10
402	600558	大西洋	431,800	3,938,016.00	0.10
403	002558	世纪游轮	24,213	3,924,685.17	0.10
404	002351	漫步者	151,800	3,899,742.00	0.10
405	600081	东风科技	173,600	3,899,056.00	0.10
406	000404	华意压缩	416,067	3,890,226.45	0.10
407	000100	TCL 集团	912,864	3,888,800.64	0.10
408	000069	华侨城 A	438,300	3,857,040.00	0.10
409	601007	金陵饭店	249,520	3,847,598.40	0.10
410	000639	西王食品	227,300	3,845,916.00	0.10
411	000899	赣能股份	332,607	3,844,936.92	0.10
412	600686	金龙汽车	199,900	3,836,081.00	0.10
413	603100	川仪股份	211,400	3,834,796.00	0.10
414	000915	山大华特	108,995	3,832,264.20	0.10
415	000540	中天城投	419,500	3,825,840.00	0.10
416	600664	哈药股份	320,074	3,818,482.82	0.10
417	601991	大唐发电	742,263	3,815,231.82	0.10
418	000776	广发证券	196,096	3,814,067.20	0.10
419	603118	共进股份	81,000	3,811,050.00	0.10
420	000669	金鸿能源	170,202	3,800,610.66	0.10
421	600239	云南城投	532,720	3,798,293.60	0.10
422	002336	人人乐	261,900	3,794,931.00	0.10
423	600073	上海梅林	267,951	3,791,506.65	0.10
424	002398	建研集团	225,030	3,780,504.00	0.10

425	000673	当代东方	108,000	3,769,200.00	0.10
426	600159	大龙地产	610,800	3,768,636.00	0.10
427	000708	大冶特钢	307,350	3,752,743.50	0.10
428	002773	康弘药业	45,650	3,752,430.00	0.10
429	002551	尚荣医疗	113,763	3,750,766.11	0.10
430	000568	泸州老窖	138,187	3,747,631.44	0.10
431	300084	海默科技	325,300	3,747,456.00	0.10
432	002280	联络互动	60,916	3,740,242.40	0.10
433	002521	齐峰新材	298,634	3,732,925.00	0.10
434	600742	一汽富维	128,400	3,728,736.00	0.10
435	002433	太安堂	249,237	3,703,661.82	0.10
436	300082	奥克股份	447,312	3,694,797.12	0.10
437	600969	郴电国际	195,048	3,692,258.64	0.10
438	000911	南宁糖业	219,707	3,680,092.25	0.09
439	002430	杭氧股份	318,800	3,666,200.00	0.09
440	601965	中国汽研	390,300	3,664,917.00	0.09
441	002249	大洋电机	274,700	3,642,522.00	0.09
442	600438	通威股份	256,318	3,642,278.78	0.09
443	300105	龙源技术	324,200	3,631,040.00	0.09
444	600327	大东方	361,115	3,614,761.15	0.09
445	002154	报喜鸟	474,700	3,612,467.00	0.09
446	603518	维格娜丝	107,000	3,610,180.00	0.09
447	000903	云内动力	434,800	3,608,840.00	0.09
448	300140	启源装备	144,800	3,605,520.00	0.09
449	300144	宋城演艺	127,072	3,596,137.60	0.09
450	300072	三聚环保	105,500	3,583,835.00	0.09
451	600284	浦东建设	261,524	3,580,263.56	0.09
452	600038	中直股份	67,866	3,578,574.18	0.09
453	000789	万年青	421,118	3,571,080.64	0.09
454	000908	景峰医药	221,470	3,570,096.40	0.09
455	600483	福能股份	207,200	3,561,768.00	0.09
456	600497	驰宏锌锗	320,600	3,539,424.00	0.09
457	002357	富临运业	212,695	3,534,990.90	0.09
458	002064	华峰氨纶	544,500	3,533,805.00	0.09
459	000916	华北高速	585,100	3,528,153.00	0.09
460	000809	铁岭新城	614,000	3,524,360.00	0.09
461	000156	华数传媒	107,414	3,523,179.20	0.09
462	600255	鑫科材料	649,495	3,520,262.90	0.09
463	300180	华峰超纤	233,633	3,483,468.03	0.09
464	600027	华电国际	511,789	3,480,165.20	0.09
465	002350	北京科锐	171,000	3,476,430.00	0.09
466	000159	国际实业	373,700	3,475,410.00	0.09
467	002190	成飞集成	79,404	3,474,719.04	0.09
468	002187	广百股份	211,871	3,466,209.56	0.09

469	000731	四川美丰	358,350	3,454,494.00	0.09
470	002651	利君股份	268,100	3,450,447.00	0.09
471	600983	惠而浦	251,282	3,440,050.58	0.09
472	002635	安洁科技	123,540	3,434,412.00	0.09
473	000960	锡业股份	254,849	3,430,267.54	0.09
474	600765	中航重机	174,100	3,419,324.00	0.09
475	002372	伟星新材	190,786	3,411,253.68	0.09
476	603077	和邦生物	504,500	3,395,285.00	0.09
477	002538	司尔特	267,700	3,375,697.00	0.09
478	002592	八菱科技	76,300	3,372,460.00	0.09
479	600491	龙元建设	369,800	3,368,878.00	0.09
480	600979	广安爱众	437,000	3,356,160.00	0.09
481	000419	通程控股	372,800	3,355,200.00	0.09
482	600869	智慧能源	351,000	3,352,050.00	0.09
483	300067	安诺其	323,080	3,350,339.60	0.09
484	002661	克明面业	62,340	3,347,658.00	0.09
485	002548	金新农	195,400	3,337,432.00	0.09
486	002275	桂林三金	142,433	3,318,688.90	0.09
487	600127	金健米业	451,700	3,306,444.00	0.09
488	000928	中钢国际	186,600	3,300,954.00	0.09
489	000525	红太阳	193,706	3,281,379.64	0.08
490	001696	宗申动力	237,301	3,279,499.82	0.08
491	600488	天药股份	443,650	3,269,700.50	0.08
492	601666	平煤股份	701,100	3,267,126.00	0.08
493	600057	象屿股份	250,413	3,265,385.52	0.08
494	600059	古越龙山	296,895	3,262,876.05	0.08
495	600351	亚宝药业	206,885	3,231,543.70	0.08
496	002036	汉麻产业	104,800	3,227,840.00	0.08
497	603678	火炬电子	37,550	3,221,414.50	0.08
498	300126	锐奇股份	182,400	3,219,360.00	0.08
499	002595	豪迈科技	140,976	3,198,745.44	0.08
500	002302	西部建设	178,773	3,185,734.86	0.08
501	600056	中国医药	190,700	3,171,341.00	0.08
502	000883	湖北能源	516,400	3,170,696.00	0.08
503	002480	新筑股份	246,400	3,153,920.00	0.08
504	300042	朗科科技	75,212	3,143,861.60	0.08
505	600399	抚顺特钢	335,297	3,141,732.89	0.08
506	000581	威孚高科	126,704	3,137,191.04	0.08
507	603939	益丰药房	74,143	3,131,058.89	0.08
508	002082	栋梁新材	306,077	3,125,046.17	0.08
509	002323	雅百特	83,283	3,119,781.18	0.08
510	000979	中弘股份	779,520	3,118,080.00	0.08
511	600419	天润乳业	87,800	3,091,438.00	0.08
512	002582	好想你	196,700	3,072,454.00	0.08

513	000910	大亚科技	185,176	3,062,811.04	0.08
514	600310	桂东电力	319,180	3,032,210.00	0.08
515	600422	昆药集团	76,028	3,027,434.96	0.08
516	601028	玉龙股份	322,419	3,021,066.03	0.08
517	002056	横店东磁	107,400	3,019,014.00	0.08
518	300273	和佳股份	143,277	2,994,489.30	0.08
519	600458	时代新材	168,820	2,988,114.00	0.08
520	000931	中关村	234,500	2,978,150.00	0.08
521	600851	海欣股份	202,400	2,975,280.00	0.08
522	600741	华域汽车	175,543	2,959,654.98	0.08
523	601766	中国中车	230,033	2,955,924.05	0.08
524	600171	上海贝岭	137,700	2,917,863.00	0.08
525	300403	地尔汉宇	47,375	2,863,818.75	0.07
526	600396	金山股份	404,600	2,856,476.00	0.07
527	601607	上海医药	143,200	2,851,112.00	0.07
528	600176	中国巨石	112,113	2,848,791.33	0.07
529	600029	南方航空	331,964	2,844,931.48	0.07
530	603899	晨光文具	66,100	2,780,166.00	0.07
531	600867	通化东宝	101,790	2,765,634.30	0.07
532	600736	苏州高新	250,527	2,755,797.00	0.07
533	600316	洪都航空	115,914	2,705,432.76	0.07
534	000519	江南红箭	159,180	2,702,876.40	0.07
535	600136	道博股份	43,200	2,693,952.00	0.07
536	000876	新希望	141,147	2,680,381.53	0.07
537	600864	哈投股份	245,845	2,674,793.60	0.07
538	000831	五矿稀土	126,300	2,614,410.00	0.07
539	300360	炬华科技	74,402	2,611,510.20	0.07
540	600350	山东高速	361,000	2,566,710.00	0.07
541	600167	联美控股	127,425	2,562,516.75	0.07
542	600485	信威集团	95,355	2,550,746.25	0.07
543	600642	申能股份	336,900	2,543,595.00	0.07
544	000567	海德股份	87,150	2,527,350.00	0.07
545	002373	千方科技	55,210	2,525,857.50	0.07
546	600058	五矿发展	110,463	2,507,510.10	0.06
547	600649	城投控股	106,500	2,466,540.00	0.06
548	600376	首开股份	195,533	2,444,162.50	0.06
549	600886	国投电力	292,666	2,443,761.10	0.06
550	002489	浙江永强	224,750	2,436,290.00	0.06
551	000418	小天鹅A	100,784	2,418,816.00	0.06
552	300398	飞凯材料	30,100	2,395,358.00	0.06
553	000009	中国宝安	131,385	2,359,674.60	0.06
554	600208	新潮中宝	490,300	2,338,731.00	0.06
555	000650	仁和药业	220,654	2,332,312.78	0.06
556	300019	硅宝科技	154,502	2,303,624.82	0.06

557	600112	天成控股	137,301	2,301,164.76	0.06
558	002504	弘高创意	76,090	2,297,918.00	0.06
559	600068	葛洲坝	291,800	2,296,466.00	0.06
560	002183	怡亚通	49,701	2,289,228.06	0.06
561	002161	远望谷	102,334	2,282,048.20	0.06
562	600098	广州发展	179,900	2,272,137.00	0.06
563	300429	强力新材	16,300	2,265,700.00	0.06
564	002665	首航节能	74,150	2,261,575.00	0.06
565	300219	鸿利光电	141,950	2,261,263.50	0.06
566	600720	祁连山	254,793	2,249,822.19	0.06
567	000898	鞍钢股份	470,000	2,241,900.00	0.06
568	000951	中国重汽	123,727	2,239,458.70	0.06
569	600429	三元股份	307,100	2,238,759.00	0.06
570	000543	皖能电力	264,085	2,236,799.95	0.06
571	600468	百利电气	125,400	2,222,088.00	0.06
572	000719	大地传媒	107,500	2,193,000.00	0.06
573	600487	亨通光电	136,600	2,177,404.00	0.06
574	000021	深科技	177,995	2,146,619.70	0.06
575	300436	广生堂	25,673	2,141,898.39	0.06
576	600426	华鲁恒升	147,054	2,121,989.22	0.05
577	002237	恒邦股份	212,172	2,117,476.56	0.05
578	002273	水晶光电	51,800	2,103,080.00	0.05
579	601333	广深铁路	419,500	2,101,695.00	0.05
580	600198	大唐电信	84,049	2,073,488.83	0.05
581	002705	新宝股份	98,934	2,068,709.94	0.05
582	603010	万盛股份	37,100	2,066,470.00	0.05
583	300399	京天利	36,820	2,064,497.40	0.05
584	300160	秀强股份	51,530	2,063,776.50	0.05
585	002120	新海股份	75,594	2,037,258.30	0.05
586	600887	伊利股份	123,862	2,035,052.66	0.05
587	000402	金融街	176,300	2,032,739.00	0.05
588	000536	华映科技	137,610	2,028,371.40	0.05
589	300479	神思电子	18,470	2,003,995.00	0.05
590	002450	康得新	52,578	2,003,221.80	0.05
591	002369	卓翼科技	149,061	1,982,511.30	0.05
592	300147	香雪制药	77,165	1,929,896.65	0.05
593	600823	世茂股份	157,440	1,925,491.20	0.05
594	600519	贵州茅台	8,824	1,925,308.56	0.05
595	600028	中国石化	386,231	1,915,705.76	0.05
596	300274	阳光电源	69,300	1,900,206.00	0.05
597	002701	奥瑞金	66,700	1,884,942.00	0.05
598	000417	合肥百货	171,600	1,875,588.00	0.05
599	600521	华海药业	73,721	1,871,776.19	0.05
600	600221	海南航空	480,000	1,867,200.00	0.05

601	300174	元力股份	58,100	1,859,200.00	0.05
602	603368	柳州医药	20,200	1,856,178.00	0.05
603	603989	艾华集团	51,850	1,850,526.50	0.05
604	600392	盛和资源	149,000	1,834,190.00	0.05
605	000055	方大集团	126,600	1,820,508.00	0.05
606	000825	太钢不锈	444,000	1,820,400.00	0.05
607	600597	光明乳业	113,007	1,799,071.44	0.05
608	600188	兖州煤业	190,007	1,795,566.15	0.05
609	002081	金螳螂	95,886	1,791,150.48	0.05
610	600428	中远航运	173,641	1,781,556.66	0.05
611	002051	中工国际	70,289	1,780,420.37	0.05
612	002146	荣盛发展	186,600	1,778,298.00	0.05
613	600717	天津港	157,300	1,772,771.00	0.05
614	000600	建投能源	166,200	1,771,692.00	0.05
615	600835	上海机电	58,300	1,767,073.00	0.05
616	000651	格力电器	78,444	1,753,223.40	0.05
617	000830	鲁西化工	250,826	1,738,224.18	0.04
618	000839	中信国安	83,100	1,691,085.00	0.04
619	300244	迪安诊断	24,100	1,675,914.00	0.04
620	601390	中国中铁	152,511	1,665,420.12	0.04
621	000732	泰禾集团	67,676	1,658,062.00	0.04
622	300425	环能科技	37,100	1,653,918.00	0.04
623	002052	同洲电子	112,800	1,652,520.00	0.04
624	600509	天富能源	167,900	1,647,099.00	0.04
625	002311	海大集团	117,700	1,644,269.00	0.04
626	002570	贝因美	109,593	1,636,223.49	0.04
627	002078	太阳纸业	288,300	1,623,129.00	0.04
628	002393	力生制药	33,600	1,622,880.00	0.04
629	600617	国新能源	105,692	1,620,258.36	0.04
630	603306	华懋科技	38,371	1,618,872.49	0.04
631	300447	全信股份	15,700	1,593,550.00	0.04
632	601117	中国化学	229,624	1,582,109.36	0.04
633	002728	台城制药	54,500	1,579,410.00	0.04
634	300446	乐凯新材	13,674	1,576,201.98	0.04
635	002331	皖通科技	58,200	1,576,056.00	0.04
636	600184	光电股份	54,472	1,574,785.52	0.04
637	600583	海油工程	175,766	1,573,105.70	0.04
638	600175	美都能源	216,900	1,568,187.00	0.04
639	002009	天奇股份	75,303	1,562,537.25	0.04
640	300457	赢合科技	23,350	1,552,775.00	0.04
641	600551	时代出版	67,900	1,544,725.00	0.04
642	600150	中国船舶	44,173	1,538,545.59	0.04
643	603338	浙江鼎力	28,750	1,534,387.50	0.04
644	300074	华平股份	103,300	1,522,642.00	0.04

645	000661	长春高新	12,500	1,505,625.00	0.04
646	300369	绿盟科技	30,860	1,501,030.40	0.04
647	000671	阳光城	164,150	1,482,274.50	0.04
648	300393	中来股份	28,500	1,480,005.00	0.04
649	600369	西南证券	149,184	1,476,921.60	0.04
650	000937	冀中能源	292,130	1,472,335.20	0.04
651	600266	北京城建	99,500	1,456,680.00	0.04
652	603998	方盛制药	28,400	1,449,252.00	0.04
653	002342	巨力索具	189,400	1,441,334.00	0.04
654	000693	华泽钴镍	77,200	1,438,236.00	0.04
655	000539	粤电力A	194,600	1,430,310.00	0.04
656	603558	健盛集团	60,000	1,397,400.00	0.04
657	600510	黑牡丹	115,900	1,394,277.00	0.04
658	600826	兰生股份	40,400	1,391,376.00	0.04
659	000060	中金岭南	97,000	1,360,910.00	0.04
660	000592	平潭发展	68,100	1,360,638.00	0.04
661	000726	鲁泰A	100,222	1,355,001.44	0.03
662	601168	西部矿业	182,700	1,350,153.00	0.03
663	002341	新纶科技	80,900	1,346,985.00	0.03
664	300096	易联众	50,400	1,344,168.00	0.03
665	603328	依顿电子	45,400	1,339,754.00	0.03
666	600635	大众公用	135,800	1,338,988.00	0.03
667	601678	滨化股份	166,942	1,338,874.84	0.03
668	002024	苏宁云商	99,385	1,336,728.25	0.03
669	002390	信邦制药	93,000	1,334,550.00	0.03
670	600548	深高速	136,100	1,333,780.00	0.03
671	300287	飞利信	73,200	1,324,920.00	0.03
672	601727	上海电气	114,600	1,322,484.00	0.03
673	000099	中信海直	89,455	1,322,144.90	0.03
674	601111	中国国航	153,551	1,317,467.58	0.03
675	300394	天孚通信	11,400	1,316,700.00	0.03
676	002001	新和成	75,200	1,311,488.00	0.03
677	300390	天华超净	29,400	1,304,772.00	0.03
678	002392	北京利尔	166,354	1,294,234.12	0.03
679	600311	ST 荣华	186,900	1,289,610.00	0.03
680	601107	四川成渝	215,600	1,287,132.00	0.03
681	600348	阳泉煤业	199,197	1,286,812.62	0.03
682	002202	金风科技	56,440	1,286,267.60	0.03
683	002194	武汉凡谷	75,553	1,284,401.00	0.03
684	300412	迦南科技	28,180	1,282,190.00	0.03
685	600703	三安光电	52,706	1,279,701.68	0.03
686	600873	梅花生物	139,845	1,278,183.30	0.03
687	300443	金雷风电	6,600	1,275,912.00	0.03
688	600546	山煤国际	287,500	1,273,625.00	0.03

689	600585	海螺水泥	73,474	1,256,405.40	0.03
690	600879	航天电子	70,082	1,252,365.34	0.03
691	000762	西藏矿业	46,900	1,233,470.00	0.03
692	002723	金莱特	48,900	1,232,280.00	0.03
693	002029	七匹狼	90,000	1,230,300.00	0.03
694	300422	博世科	27,200	1,225,632.00	0.03
695	603169	兰石重装	67,100	1,224,575.00	0.03
696	002121	科陆电子	40,900	1,210,640.00	0.03
697	600560	金自天正	64,600	1,198,330.00	0.03
698	603005	晶方科技	23,807	1,197,492.10	0.03
699	603017	中衡设计	25,700	1,191,709.00	0.03
700	300043	互动娱乐	75,100	1,186,580.00	0.03
701	603688	石英股份	49,400	1,181,648.00	0.03
702	002375	亚厦股份	74,522	1,175,211.94	0.03
703	603997	继峰股份	43,300	1,169,533.00	0.03
704	002718	友邦吊顶	19,020	1,150,710.00	0.03
705	000550	江铃汽车	38,100	1,142,238.00	0.03
706	600885	宏发股份	37,600	1,123,864.00	0.03
707	600089	特变电工	95,095	1,119,268.15	0.03
708	000725	京东方 A	374,132	1,111,172.04	0.03
709	300215	电科院	56,100	1,110,780.00	0.03
710	002292	奥飞动漫	21,454	1,109,386.34	0.03
711	300108	双龙股份	68,100	1,103,220.00	0.03
712	600812	华北制药	127,900	1,101,219.00	0.03
713	603601	再升科技	26,840	1,092,388.00	0.03
714	600755	厦门国贸	115,100	1,072,732.00	0.03
715	600895	张江高科	37,200	1,072,476.00	0.03
716	002204	大连重工	107,200	1,072,000.00	0.03
717	002267	陕天然气	84,876	1,069,437.60	0.03
718	600993	马应龙	48,500	1,067,970.00	0.03
719	600298	安琪酵母	34,920	1,062,266.40	0.03
720	600776	东方通信	92,100	1,053,624.00	0.03
721	300039	上海凯宝	75,220	1,042,549.20	0.03
722	002749	国光股份	10,400	1,042,080.00	0.03
723	000810	创维数字	81,941	1,038,192.47	0.03
724	002672	东江环保	51,400	1,036,738.00	0.03
725	600759	洲际油气	130,960	1,028,036.00	0.03
726	603788	宁波高发	26,600	1,023,568.00	0.03
727	300430	诚益通	17,560	1,023,396.80	0.03
728	002344	海宁皮城	66,700	1,023,178.00	0.03
729	000415	渤海租赁	112,900	1,018,358.00	0.03
730	000919	金陵药业	59,200	1,018,240.00	0.03
731	300374	恒通科技	36,900	1,014,750.00	0.03
732	600187	国中水务	163,000	1,012,230.00	0.03

733	000735	罗牛山	132,400	1,002,268.00	0.03
734	600997	开滦股份	179,252	1,000,226.16	0.03
735	300381	溢多利	17,800	997,512.00	0.03
736	601588	北辰实业	184,800	990,528.00	0.03
737	600516	方大炭素	78,700	984,537.00	0.03
738	600409	三友化工	126,600	981,150.00	0.03
739	600352	浙江龙盛	83,808	975,525.12	0.03
740	002241	歌尔声学	28,100	972,260.00	0.03
741	000738	中航动控	30,600	967,572.00	0.02
742	000423	东阿阿胶	18,328	958,554.40	0.02
743	600269	赣粤高速	166,100	943,448.00	0.02
744	600831	广电网络	59,300	937,533.00	0.02
745	600177	雅戈尔	57,400	934,472.00	0.02
746	601225	陕西煤业	191,200	929,232.00	0.02
747	600970	中材国际	77,490	926,005.50	0.02
748	600674	川投能源	86,004	925,403.04	0.02
749	600158	中体产业	35,400	923,232.00	0.02
750	300428	四通新材	15,300	923,202.00	0.02
751	601001	大同煤业	166,100	921,855.00	0.02
752	300445	康斯特	15,850	915,971.50	0.02
753	601901	方正证券	95,200	913,920.00	0.02
754	600406	国电南瑞	53,606	894,148.08	0.02
755	600403	大有能源	149,600	890,120.00	0.02
756	002503	搜于特	55,800	883,872.00	0.02
757	600507	方大特钢	144,000	878,400.00	0.02
758	300241	瑞丰光电	48,328	869,904.00	0.02
759	002727	一心堂	14,800	855,884.00	0.02
760	601888	中国国旅	14,404	854,301.24	0.02
761	600067	冠城大通	96,703	845,184.22	0.02
762	600655	豫园商城	52,001	840,336.16	0.02
763	600780	通宝能源	118,500	840,165.00	0.02
764	600372	中航电子	33,800	832,494.00	0.02
765	600162	香江控股	90,600	825,366.00	0.02
766	300124	汇川技术	17,300	816,560.00	0.02
767	300421	力星股份	21,339	811,735.56	0.02
768	002008	大族激光	31,095	805,049.55	0.02
769	300248	新开普	21,538	800,136.70	0.02
770	000582	北部湾港	35,500	799,105.00	0.02
771	600410	华胜天成	30,000	795,300.00	0.02
772	000777	中核科技	25,300	794,167.00	0.02
773	600748	上实发展	58,800	789,096.00	0.02
774	000401	冀东水泥	72,200	786,980.00	0.02
775	600584	长电科技	35,658	785,189.16	0.02
776	603519	立霸股份	14,686	781,882.64	0.02

777	600618	氯碱化工	48,400	781,176.00	0.02
778	002444	巨星科技	37,700	780,390.00	0.02
779	600724	宁波富达	102,500	775,925.00	0.02
780	600256	广汇能源	115,166	768,157.22	0.02
781	600549	厦门钨业	40,760	766,695.60	0.02
782	002415	海康威视	22,200	763,458.00	0.02
783	600435	北方导航	26,473	759,775.10	0.02
784	600289	亿阳信通	37,794	744,541.80	0.02
785	002700	新疆浩源	50,694	738,611.58	0.02
786	300417	南华仪器	7,200	736,416.00	0.02
787	601857	中国石油	88,100	735,635.00	0.02
788	000636	风华高科	64,200	732,522.00	0.02
789	600088	中视传媒	24,100	725,651.00	0.02
790	002184	海得控制	16,800	722,568.00	0.02
791	601989	中国重工	76,800	721,920.00	0.02
792	002230	科大讯飞	19,412	719,214.60	0.02
793	601208	东材科技	76,407	715,933.59	0.02
794	300197	铁汉生态	41,800	715,198.00	0.02
795	600277	亿利能源	78,600	712,902.00	0.02
796	002293	罗莱生活	39,000	711,360.00	0.02
797	600309	万华化学	39,600	706,860.00	0.02
798	300003	乐普医疗	18,300	706,380.00	0.02
799	600804	鹏博士	29,700	704,484.00	0.02
800	000970	中科三环	50,190	704,165.70	0.02
801	002456	欧菲光	22,700	704,154.00	0.02
802	600168	武汉控股	71,900	695,992.00	0.02
803	002663	普邦园林	87,500	694,750.00	0.02
804	600398	海澜之家	49,636	692,918.56	0.02
805	000780	平庄能源	119,400	685,356.00	0.02
806	601669	中国电建	83,429	669,934.87	0.02
807	300472	新元科技	11,500	669,300.00	0.02
808	300488	恒锋工具	7,500	666,000.00	0.02
809	603188	亚邦股份	29,600	662,448.00	0.02
810	002463	沪电股份	100,920	651,943.20	0.02
811	000547	航天发展	34,200	651,510.00	0.02
812	601098	中南传媒	27,241	651,059.90	0.02
813	603555	贵人鸟	18,300	648,369.00	0.02
814	000625	长安汽车	37,300	632,981.00	0.02
815	002140	东华科技	29,200	621,960.00	0.02
816	002475	立讯精密	19,400	619,830.00	0.02
817	600875	东方电气	44,000	599,720.00	0.02
818	000792	盐湖股份	23,300	598,344.00	0.02
819	601999	出版传媒	47,000	596,900.00	0.02
820	002042	华孚色纺	49,450	595,872.50	0.02

821	600200	江苏吴中	21,354	595,563.06	0.02
822	300083	劲胜精密	12,400	586,768.00	0.02
823	600313	农发种业	38,200	579,876.00	0.01
824	601006	大秦铁路	65,597	565,446.14	0.01
825	002013	中航机电	24,900	564,234.00	0.01
826	000413	东旭光电	61,800	561,144.00	0.01
827	600815	厦工股份	59,400	554,796.00	0.01
828	601799	星宇股份	14,700	554,337.00	0.01
829	000932	华菱钢铁	169,300	551,918.00	0.01
830	000666	经纬纺机	17,900	537,895.00	0.01
831	002648	卫星石化	49,500	535,095.00	0.01
832	002594	比亚迪	8,300	534,520.00	0.01
833	300349	金卡股份	14,050	530,387.50	0.01
834	600330	天通股份	36,100	530,309.00	0.01
835	300004	南风股份	19,800	526,482.00	0.01
836	300071	华谊嘉信	36,700	521,140.00	0.01
837	600688	上海石化	80,300	520,344.00	0.01
838	300267	尔康制药	15,400	517,440.00	0.01
839	002501	利源精制	41,100	517,038.00	0.01
840	601179	中国西电	75,500	514,155.00	0.01
841	600276	恒瑞医药	10,300	505,936.00	0.01
842	600100	同方股份	27,843	503,401.44	0.01
843	600425	青松建化	85,400	498,736.00	0.01
844	600290	华仪电气	32,300	497,743.00	0.01
845	000921	海信科龙	52,027	495,817.31	0.01
846	300152	科融环境	44,100	494,361.00	0.01
847	601186	中国铁建	36,300	489,324.00	0.01
848	600271	航天信息	8,700	486,417.00	0.01
849	000902	新洋丰	15,800	481,110.00	0.01
850	000657	中钨高新	29,400	470,694.00	0.01
851	002470	金正大	23,000	467,820.00	0.01
852	601216	君正集团	40,700	466,015.00	0.01
853	600193	创兴资源	31,200	460,200.00	0.01
854	002508	老板电器	10,238	460,198.10	0.01
855	600658	电子城	32,800	458,216.00	0.01
856	600518	康美药业	26,700	452,565.00	0.01
857	600537	亿晶光电	30,100	450,898.00	0.01
858	002294	信立泰	14,854	447,402.48	0.01
859	600502	安徽水利	32,600	445,642.00	0.01
860	600019	宝钢股份	79,599	444,162.42	0.01
861	601005	重庆钢铁	134,100	441,189.00	0.01
862	601699	潞安环能	67,830	435,468.60	0.01
863	000400	许继电气	22,303	433,347.29	0.01
864	600300	维维股份	60,200	431,634.00	0.01

865	600743	华远地产	62,400	423,072.00	0.01
866	600096	云天化	32,300	418,931.00	0.01
867	000528	柳工	50,500	418,645.00	0.01
868	600770	综艺股份	22,800	416,556.00	0.01
869	600596	新安股份	40,800	416,160.00	0.01
870	600570	恒生电子	6,763	412,340.11	0.01
871	002129	中环股份	33,700	411,814.00	0.01
872	002122	天马股份	49,200	409,836.00	0.01
873	600397	安源煤业	69,200	404,128.00	0.01
874	600035	楚天高速	61,300	402,128.00	0.01
875	601369	陕鼓动力	44,000	384,560.00	0.01
876	002497	雅化集团	43,800	382,812.00	0.01
877	002327	富安娜	31,816	382,746.48	0.01
878	600050	中国联通	61,819	382,041.42	0.01
879	600811	东方集团	43,900	381,052.00	0.01
880	600702	沱牌舍得	16,400	375,396.00	0.01
881	002236	大华股份	10,100	372,690.00	0.01
882	601992	金隅股份	39,720	372,176.40	0.01
883	600138	中青旅	15,800	368,298.00	0.01
884	002271	东方雨虹	18,700	365,211.00	0.01
885	600322	天房发展	66,600	356,976.00	0.01
886	000709	河北钢铁	106,000	352,980.00	0.01
887	000563	陕国投 A	23,174	350,390.88	0.01
888	601866	中海集运	48,800	343,552.00	0.01
889	000338	潍柴动力	34,600	334,236.00	0.01
890	601101	昊华能源	42,300	332,478.00	0.01
891	600449	宁夏建材	29,644	332,012.80	0.01
892	601928	凤凰传媒	20,700	329,751.00	0.01
893	002242	九阳股份	14,500	328,860.00	0.01
894	600690	青岛海尔	32,300	320,416.00	0.01
895	600614	鼎立股份	27,100	315,173.00	0.01
896	600750	江中药业	8,716	307,587.64	0.01
897	002698	博实股份	10,344	303,389.52	0.01
898	600578	京能电力	47,300	287,111.00	0.01
899	600601	方正科技	43,400	268,212.00	0.01
900	002681	奋达科技	5,960	260,452.00	0.01
901	600132	重庆啤酒	16,000	255,840.00	0.01
902	000553	沙隆达 A	23,874	255,451.80	0.01
903	002385	大北农	20,850	254,578.50	0.01
904	002653	海思科	11,400	249,546.00	0.01
905	600373	中文传媒	10,500	246,645.00	0.01
906	000988	华工科技	11,300	239,334.00	0.01
907	600037	歌华有线	10,869	234,009.57	0.01
908	000063	中兴通讯	12,515	233,154.45	0.01

909	600415	小商品城	24,400	224,236.00	0.01
910	000559	万向钱潮	9,600	217,248.00	0.01
911	600157	永泰能源	44,800	213,696.00	0.01
912	002646	青青稞酒	9,300	212,226.00	0.01
913	000552	靖远煤电	19,100	192,528.00	0.00
914	002216	三全食品	15,774	179,665.86	0.00
915	600009	上海机场	5,900	174,168.00	0.00
916	600640	号百控股	8,200	173,922.00	0.00
917	600111	北方稀土	11,400	159,828.00	0.00
918	000852	石化机械	6,100	130,296.00	0.00
919	600108	亚盛集团	17,400	127,716.00	0.00
920	601800	中国交建	9,400	126,054.00	0.00
921	601231	环旭电子	8,000	115,680.00	0.00
922	601899	紫金矿业	32,500	114,400.00	0.00
923	600189	吉林森工	8,700	112,143.00	0.00
924	600219	南山铝业	16,600	109,228.00	0.00
925	002025	航天电器	4,200	109,158.00	0.00
926	000023	深天地A	3,500	106,855.00	0.00
927	002223	鱼跃医疗	2,700	103,815.00	0.00
928	300115	长盈精密	2,800	93,996.00	0.00
929	000598	兴蓉环境	12,400	88,288.00	0.00
930	601118	海南橡胶	9,200	69,552.00	0.00
931	600572	康恩贝	5,169	69,057.84	0.00
932	002783	凯龙股份	500	63,900.00	0.00
933	002461	珠江啤酒	4,123	62,958.21	0.00
934	600110	中科英华	6,500	62,725.00	0.00
935	600010	包钢股份	17,064	61,601.04	0.00
936	600395	盘江股份	6,176	50,704.96	0.00
937	300427	红相电力	500	38,005.00	0.00
938	300434	金石东方	500	32,320.00	0.00
939	601198	东兴证券	1,000	29,970.00	0.00
940	300405	科隆精化	500	29,495.00	0.00
941	002756	永兴特钢	500	27,000.00	0.00
942	300415	伊之密	1,000	23,210.00	0.00
943	002743	富煌钢构	500	18,625.00	0.00
944	002732	燕塘乳业	500	17,900.00	0.00
945	300452	山河药辅	71	7,582.80	0.00
946	600053	中江地产	98	5,753.58	0.00
947	300291	华录百纳	98	3,488.80	0.00
948	600408	*ST 安泰	68	359.72	0.00

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	601318	中国平安	207,332,458.78	2.55
2	002673	西部证券	168,607,125.31	2.08
3	600036	招商银行	132,902,511.80	1.64
4	000686	东北证券	113,946,627.30	1.40
5	601009	南京银行	109,536,422.47	1.35
6	002142	宁波银行	100,468,144.17	1.24
7	601169	北京银行	94,794,971.52	1.17
8	601988	中国银行	89,155,920.66	1.10
9	601939	建设银行	85,710,285.91	1.06
10	601166	兴业银行	84,531,710.23	1.04
11	000001	平安银行	83,938,413.64	1.03
12	600252	中恒集团	78,605,445.09	0.97
13	600015	华夏银行	74,626,816.62	0.92
14	600837	海通证券	74,600,664.73	0.92
15	600000	浦发银行	73,062,752.83	0.90
16	000100	TCL 集团	72,294,338.53	0.89
17	601328	交通银行	67,378,088.15	0.83
18	300059	东方财富	65,404,615.86	0.81
19	000039	中集集团	64,578,944.66	0.80
20	000750	国海证券	63,707,901.09	0.78

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	601318	中国平安	288,233,129.91	3.55
2	002673	西部证券	281,949,587.49	3.47
3	600036	招商银行	178,652,760.21	2.20
4	600000	浦发银行	158,013,692.92	1.95
5	600016	民生银行	139,832,935.46	1.72
6	601169	北京银行	126,161,830.56	1.55
7	600837	海通证券	121,888,461.02	1.50
8	600252	中恒集团	118,870,510.74	1.46
9	601009	南京银行	114,793,826.62	1.41

10	601166	兴业银行	112,867,564.26	1.39
11	601628	中国人寿	112,741,913.81	1.39
12	601668	中国建筑	102,755,698.48	1.27
13	002142	宁波银行	102,059,843.66	1.26
14	601988	中国银行	99,115,754.55	1.22
15	601328	交通银行	96,071,348.74	1.18
16	000686	东北证券	95,014,342.63	1.17
17	600030	中信证券	90,891,856.68	1.12
18	600015	华夏银行	88,304,798.68	1.09
19	601939	建设银行	88,051,946.95	1.08
20	002595	豪迈科技	87,726,325.38	1.08

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

买入股票的成本（成交）总额	18,279,497,996.81
卖出股票的收入（成交）总额	25,938,098,537.59

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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所有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

本基金本报告期末投资贵金属。

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

本基金本报告期末投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期不能投资股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,938,607.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	60,269.77
5	应收申购款	380,134.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,379,012.41

8.12.3 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
179,681	14,036.92	5,051,681.23	0.20%	2,517,115,268.79	99.80%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有 本基金	57,908.71	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
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(2004年8月27日)基金份额总额	2,544,287,215.94
本报告期期初基金份额总额	7,827,450,527.93
本报告期基金总申购份额	365,689,082.69
减：本报告期基金总赎回份额	5,670,972,660.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,522,166,950.02

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

李常青先生自 2015 年 2 月 28 日起担任本基金管理人督察长；自李常青先生担任督察长职务之日起，陶耿先生不再代行督察长职务。经公司管理层批准及八届十九次董事会审议通过，自 2015 年 11 月 11 日起，张弛因个人原因正式离职。经公司八届二十一次董事会会议审议通过，自 2016 年 3 月 3 日起，陶耿先生正式离任公司总经理一职，由林昌先生代任公司总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬情况是 10 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 11 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	315,037,268.85	0.71%	286,879.65	0.72%	-
中信建投	1	345,540,687.18	0.78%	314,579.74	0.79%	-
中泰证券	1	410,367,129.93	0.93%	382,174.81	0.96%	-
中信证券	1	562,930,001.93	1.27%	512,491.17	1.29%	-
申银万国	1	615,444,975.16	1.39%	565,754.98	1.42%	-
银河证券	2	654,871,323.10	1.48%	609,882.15	1.53%	-

广发证券	1	707,537,745.38	1.60%	626,319.18	1.58%	-
平安证券	1	759,566,696.62	1.72%	679,479.12	1.71%	-
中金公司	1	786,525,663.86	1.78%	716,091.32	1.80%	-
中银国际	1	801,067,025.33	1.81%	729,288.86	1.83%	-
长江证券	1	1,194,842,045.88	2.70%	1,088,111.10	2.74%	-
中投建银	1	1,466,297,425.92	3.32%	1,316,806.48	3.31%	-
国金证券	1	1,630,292,187.23	3.69%	1,442,648.03	3.63%	-
宏源证券	1	1,753,121,101.91	3.97%	1,588,969.91	4.00%	-
瑞银证券	1	1,777,476,253.46	4.02%	1,572,892.03	3.96%	-
东方证券	1	1,954,649,288.83	4.42%	1,780,774.15	4.48%	-
海通证券	1	1,956,415,184.64	4.43%	1,731,825.55	4.36%	-
高华证券	1	2,074,501,165.49	4.69%	1,896,254.28	4.77%	-
安信证券	1	2,839,227,828.57	6.43%	2,584,829.58	6.50%	-
国信证券	1	3,958,546,544.35	8.96%	3,506,702.20	8.82%	-
兴业证券	1	4,652,563,505.41	10.53%	4,235,689.28	10.65%	-
光大证券	3	12,972,898,770.44	29.36%	11,587,546.13	29.15%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）新增租用交易单元

本报告期内本基金新增租用交易单元3个：海通证券、国金证券、瑞银证券（399152）

（2）专用交易单元的选择标准和程序

A. 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

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，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，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；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

B. 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照A中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进

行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

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

本报告期内本基金未通过租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-01-21
2	关于旗下部分基金新增宜信普泽投资顾问(北京)有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-02-10
3	关于旗下部分基金参与上海联泰资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-02-10
4	关于旗下基金投资资产支持证券的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-02-12
5	关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-03-03
6	关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-03-20
7	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-03-30
8	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-03-30
9	关于旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-01
10	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-11
11	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-11
12	关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-15

13	光大保德信量化核心证券投资基金分红公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-18
14	关于旗下基金新增上海汇付金融服务有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-18
15	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-20
16	关于旗下基金通过网上直销进行基金转换业务的转换费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-20
17	关于旗下部分基金参加兴业银行电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-23
18	关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-28
19	关于旗下部分基金继续参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-06-29
20	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年第 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-07-21
21	关于旗下基金新增浙江金观诚财富管理有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-08-20
22	关于调整网上直销平台(含移动终端)快捷支付基金申购、定期定额投资优惠费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-08-27
23	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-08-28
24	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年半年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-08-28
25	关于旗下部分基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-08-31
26	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-09
27	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-09
28	光大保德信基金管理有限公司新增深圳富济财富管理有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-14
29	光大保德信基金管理有限公司新增大泰金石投资管理有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-14
30	光大保德信基金管理有限公司新增北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-20
31	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-26
32	光大保德信基金管理有限公司新增上海凯石财富基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-10-29

33	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中经北证（北京）资产管理有限公司为代销机构并参与其交易费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-11-16
34	光大保德信基金管理有限公司新增珠海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-11-26
35	关于旗下部分基金新增广州证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-12-15
36	关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-12-18
37	关于旗下 18 只基金针对熔断机制调整申购、赎回等业务规则的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-12-31
38	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-12-31

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网网站 www.epf.com.cn，光大保德信基金管理有限公司客服电话：4008-202-888 或 021-53524620。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日