

光大保德信量化核心证券投资基金
2014 年年度报告
2014 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：二〇一五年三月三十日

§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 2015 年 3 月 27 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 2014 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 2014 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.....	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	17
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.....	17
§6 审计报告	17
6.1 管理层对财务报表的责任.....	17
6.2 注册会计师的责任.....	17
6.3 审计意见.....	18
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	71
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	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
§10 开放式基金份额变动	73
§11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	79

§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	7,827,450,527.93 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	徐蓉	张建春
	联系电话	021-33074700-3110	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		400-820-2888, 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号中国光大中心
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	2014 年	2013 年	2012 年
本期已实现收益	602,123,500.65	626,244,512.48	-1,038,116,350.60
本期利润	1,213,162,384.86	1,110,509,928.02	678,089,286.98
加权平均基金份额本期利润	0.1332	0.1047	0.0587
本期加权平均净值利润率	15.17%	12.35%	7.88%
本期基金份额净值增长率	16.91%	13.07%	8.31%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
期末可供分配利润	731,451,465.04	137,295,175.84	-510,036,717.50
期末可供分配基金份额利润	0.0934	0.0134	-0.0456
期末基金资产净值	8,116,652,407.37	9,072,864,632.94	8,780,605,442.58
期末基金份额净值	1.0369	0.8869	0.7844
3.1.3 累计期末指标	2014 年末	2013 年末	2012 年末
基金份额累计净值增长率	267.05%	213.95%	177.66%

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	9.18%	1.28%	39.13%	1.48%	-29.95%	-0.20%
过去六个月	25.55%	1.06%	55.63%	1.19%	-30.08%	-0.13%
过去一年	16.91%	1.06%	44.19%	1.09%	-27.28%	-0.03%

过去三年	43.18%	1.20%	50.33%	1.16%	-7.15%	0.04%
过去五年	9.40%	1.30%	6.34%	1.21%	3.06%	0.09%
自基金合同生效起至今	267.05%	1.68%	224.12%	1.58%	42.93%	0.10%

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

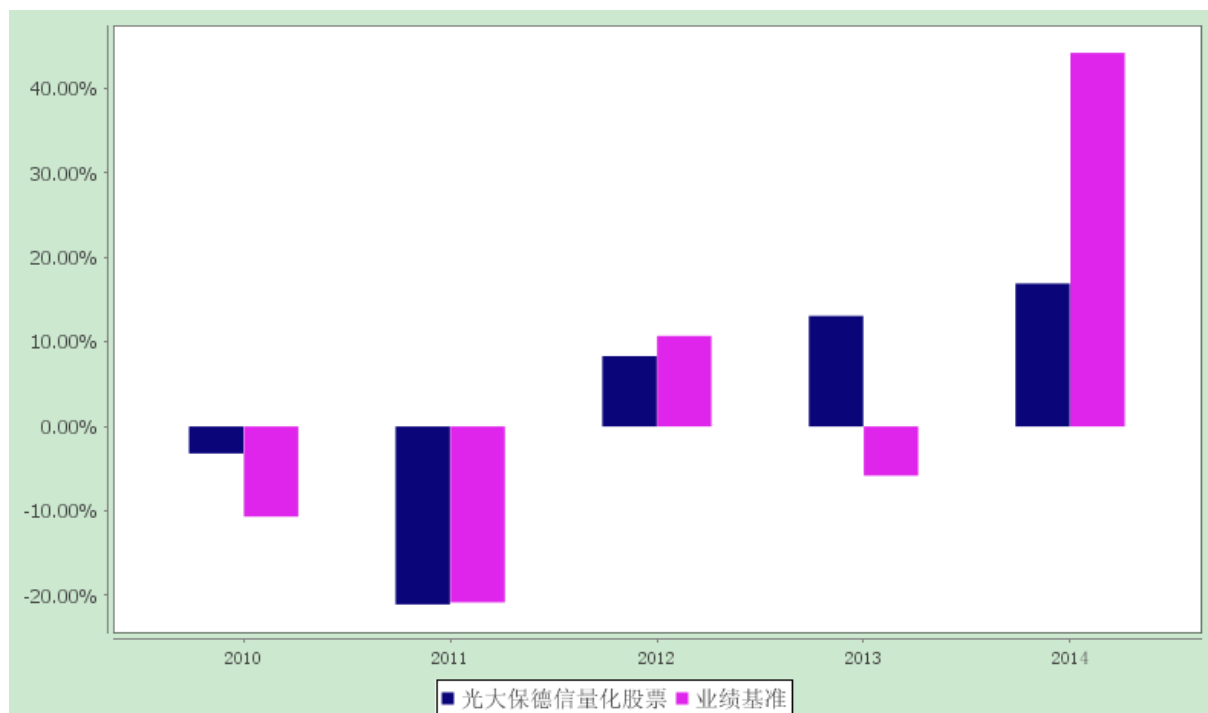
光大保德信量化核心证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2004 年 8 月 27 日至 2014 年 12 月 31 日)



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
2012	-	-	-	-	-
2013	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内不进行利润分配。本基金管理人决定于 2015 年 4 月份完成 2014 年度基金利润分配。

§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 2014 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 17 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、光大保德信红利股票型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘股票型证券投资基金、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股票型证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、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股票型证券投资基金和光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金。

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		
钱钧	权益投资总监、基金经理	2010-12-07	2014-01-09	14 年	钱钧先生，硕士。毕业于南京大学国际工商管理学院，获工商管理硕士学位，曾在联合证券担任高级研究员，在西部证券担任投资经理助理等工作。2007 年 1 月加入光大保德信基金管理有限公司任高级研究员，曾任光大保德信权益投资总监、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。钱钧已于 2014 年 1 月 9 日离职。
周炜炜	首席投资总监、基金经理	2014-01-09	2014-08-02	12 年	周炜炜先生，CFA，伦敦商学院金融学硕士、香港大学商学院-复旦大学管理学院工商管理硕士。1998 年至 2000 年任职于德意志银行上海分行，任助理副总裁；2000 年至 2001 年任职于美国思腾思特管理咨询中国有限公司，任副总裁；2002 年至 2006 年任职于招商基金管理有限公司，历任招商先锋证券投资基金基金经理、基金管理部副总监；2006 年至 2010 年

					10 月任职于交银施罗德基金管理有限公司，历任交银施罗德成长股票证券投资基金基金经理、权益投资部总经理、投资副总监；2010 年 11 月至 2014 年 8 月任职于光大保德信基金管理有限公司，历任首席投资总监、光大保德信优势配置股票型证券投资基金基金经理、光大保德信量化核心证券投资基金基金经理。
田大伟	基金经理	2014-02-25	-	5 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 = $(B \text{ 组合交易均价} / A \text{ 组合交易均价} - 1)$ ，卖出溢价率 = $(A \text{ 组合交易均价} / B \text{ 组合交易均价} - 1)$ ；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

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内投资组合之间，因投资策略调整需要，出现 5 次同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。经检查和分析未发现异常情况。

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 2014 年，我们加强了对新常态经济（我们称之为存量经济）下跨行业的研究投资，并取得了较好的业绩。

目前我国经济逐步迈入了经济增长窄幅区间波动的转型期，我们很难看到经济发生大起大落的变化，各行业依托经济内生增长动力所提供的增量将会变少，行业间的壁垒与分割也在不断消除。在这种新常态经济下跨行业的投资机会凸显，我们将其主要概况为“存量经济本身自发的机会”以及“政策改革带来的机会”，成为我们研究投资的重中之中。

对于“存量经济本身自发的机会”，本基金认为主要可以概括为下面四个方面的机会：“后端市场”、“供给收缩”、“长尾消费”以及“存量替代”等。其中，“后端市场”是指在存量经济下，例如地产等一些行业已很难再产生增量，但随着使用年限的增长，“后端需求”将逐渐产生出来。“供给收缩”是针对化工、水泥等传统行业而言的。本基金认为随着增量经济的过去，也许这些行业的整体盈利增速在下降，但这些行业中的优质龙头公司可以通过集中度的提高来改善其产品的市场供需结构，从而使业绩逆行业而增长。另外，“长尾消费”指的是依托移动互联汇集的“小众消费”，例如互联网金融等。“存量替代”指的是新产品将有机会对原有庞大的存量进行替代，例如新能源等。

对于“政策改革带来的机会”，我们认为经济的趋势一是取决于经济本身的周期动力，二是取决于政策调控的方向和力度。十八届三中全会《中共中央关于全面深化改革重大问题决定》是中国政策经济改革的纲领性文件，不仅将带来经济、产业、社会、金融、生态领域的全方位变化，也对股票市场影响深远。本基金将遵循新一届政府改革思路，重点关注五大方向的政策经济改革带来的机会。一是安全建设：国防安全、信息安全、消费安全；二是破除垄断：民营金融、油气、医院、传媒、环保；三是国企改革：业绩和估值引来“戴维斯”双击；四是生态变革：环保产业链中游或受益于过剩产能淘汰的结构性机会；五是网络创新：铁路、4G、互联网对传统行业的重构。

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 16.91%，业绩比较基准收益率为 44.19%。

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 2015 年，经济从总量数据上看仍处于下降通道中，但微观经济数据表明我国经济增速即将触底，我们形容目前的经济为“乌云的金边”，并大胆预测明年企业盈利将逆经济总量指标而向上增长，并成为支撑明年市场向上的最主要的力量。

我们认为政策在“供给”和“需求”端都将发力，但最大的亮点是企业成本的下降：融资成本、能源成本、减税、国企改革。就社会融资成本而言，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。随着市场对政府“经济区间管理”和“改革信心”的增强，风险溢价下行可期，成为 2015 年企业盈利回升的重要力量之一。目前美国经济回升，美元升值启动，美联储加息 2015 年年中可期，在此背景下的能源成本下行将成为我国企业盈利回升的另一个重要力量。与此同时，“一带一路”、京津冀协同发展、长江经济带三大战略是支撑经济，消化过剩、落后产量的最重要承接体，明年财政政策将会更加有力度，减税是亮点。最后，国企改革是我国经济改革的核心，其指向就是企业盈利提升。

目前，投资者对股票市场的信心在不断增强。本基金将力争把握好股票投资的新机遇，找准时机，把握好方向，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终按照法律法规、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验，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，本基金本报告期内不进行利润分配。

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

2014 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2014 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 2014 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(2015)审字第 60467078_B01 号

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 2014 年 12 月 31 日的资产负债表和 2014 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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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 蒋燕华
 中国注册会计师 边卓群
 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
 2014 年 3 月 26 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：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	634,001,672.57	481,010,336.93
结算备付金		32,528,294.49	9,476,999.02
存出保证金		2,093,598.27	1,626,242.24
交易性金融资产	7.4.7.2	7,508,779,565.78	8,530,218,518.47
其中：股票投资		7,508,779,565.78	8,530,218,518.47
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	80,545,526.57
应收利息	7.4.7.5	154,109.81	104,716.52
应收股利		-	-
应收申购款		191,181.99	260,344.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,178,773,157.66	9,103,242,684.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 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		30,450,373.38	9,776,488.11
应付管理人报酬	7.4.10.2	10,468,287.30	11,794,431.37
应付托管费	7.4.10.2	1,744,714.56	1,965,738.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	19,054,677.18	6,093,239.90
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	402,697.87	748,153.51
负债合计		62,120,750.29	30,378,051.46
所有者权益：		-	-

实收基金	7.4.7.9	2,832,275,090.22	3,701,557,399.17
未分配利润	7.4.7.10	5,284,377,317.15	5,371,307,233.77
所有者权益合计		8,116,652,407.37	9,072,864,632.94
负债和所有者权益总计		8,178,773,157.66	9,103,242,684.40

注：报告截止日 2014 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0369 元，基金份额总额 7,827,450,527.93 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
一、收入		1,430,042,630.17	1,309,488,430.62
1.利息收入		4,948,417.07	4,593,984.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,948,417.07	4,593,984.16
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）		813,390,171.52	820,390,599.53
其中：股票投资收益	7.4.7.12	659,621,187.19	659,827,849.29
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	153,768,984.33	160,562,750.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.18	611,038,884.21	484,265,415.54

填列)			
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	665,157.37	238,431.39
减: 二、费用		216,880,245.31	198,978,502.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2	120,124,219.54	134,979,318.81
2. 托管费	7.4.10.2	20,020,703.33	22,496,553.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	76,335,322.44	41,100,911.79
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	401,718.84
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		1,213,162,384.86	1,110,509,928.02
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		1,213,162,384.86	1,110,509,928.02

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: 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期		
	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	-869,282,308.95	-1,300,092,301.48	-2,169,374,610.43

(净值减少以“-”号填列)			
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
项目	上年度可比期间		
	2013年1月1日至2013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)	4,050,532,484.01	4,730,072,958.57	8,780,605,442.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,110,509,928.02	1,110,509,928.02
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)	-348,975,084.84	-469,275,652.82	-818,250,737.66
其中: 1.基金申购款	259,392,665.76	371,314,388.89	630,707,054.65
2.基金赎回款	-608,367,750.60	-840,590,041.71	-1,448,957,792.31
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)	3,701,557,399.17	5,371,307,233.77	9,072,864,632.94

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：陶耿，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，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 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（主要系权证投资）；

(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。

(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

本年度本基金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

本基金本报告期会计政策变更的说明在 7.4.2 会计报表的编制基础中披露。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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。

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	634,001,672.57	481,010,336.93
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	634,001,672.57	481,010,336.93

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 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
项目		上年度末		
		2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		8,582,223,562.53	8,530,218,518.47	-52,005,044.06
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		8,582,223,562.53	8,530,218,518.47	-52,005,044.06

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	138,526.75	99,716.09
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	14,637.80	4,264.70
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	3.06	3.93
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	942.20	731.80
合计	154,109.81	104,716.52

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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	19,054,677.18	6,093,239.90
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	19,054,677.18	6,093,239.90

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2014 年 12 月 31 日	2013 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	250,000.00
应付赎回费	2,697.87	3,359.34
其他	-	194,794.17
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	200,000.00
合计	402,697.87	748,153.51

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,229,878,724.51	3,701,557,399.17
本期申购	444,675,845.52	160,904,636.49
本期赎回（以“-”号填列）	-2,847,104,042.10	-1,030,186,945.44
本期末	7,827,450,527.93	2,832,275,090.22

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	137,295,175.84	5,234,012,057.93	5,371,307,233.77
本期利润	602,123,500.65	611,038,884.21	1,213,162,384.86
本期基金份额交易产生的变动数	-7,967,211.45	-1,292,125,090.03	-1,300,092,301.48
其中：基金申购款	8,959,490.09	247,092,636.15	256,052,126.24
基金赎回款	-16,926,701.54	-1,539,217,726.18	-1,556,144,427.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	731,451,465.04	4,552,925,852.11	5,284,377,317.15

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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,648,159.81	4,378,367.56
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	263,165.94	177,816.24
其他	37,091.32	37,800.36
合计	4,948,417.07	4,593,984.16

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
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	25,903,694,099.03	13,698,749,355.71
减：卖出股票成本总额	25,244,072,911.84	13,038,921,506.42
买卖股票差价收入	659,621,187.19	659,827,849.29

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
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
股票投资产生的股利收益	153,768,984.33	160,562,750.24
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	153,768,984.33	160,562,750.24

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
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
1.交易性金融资产	611,038,884.21	484,265,415.54
——股票投资	611,038,884.21	484,265,415.54
——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	611,038,884.21	484,265,415.54

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
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
基金赎回费收入	568,852.61	201,986.97
转换费收入	96,304.76	36,444.42
其他收入-印花税返还	-	-
其他收入-其他	-	-
合计	665,157.37	238,431.39

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
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013年12月31日
交易所市场交易费用	76,335,322.44	41,100,911.79
银行间市场交易费用	-	-
合计	76,335,322.44	41,100,911.79

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
	2014年1月1日至2014年12月31日	2013年1月1日至2013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	-	1,718.84
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	401,718.84

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

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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	17,968,240,900.42	36.29%	10,856,877,285.31	40.46%

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 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%

关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	9,736,948.24	40.30%	3,046,330.21	50.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券
结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的
证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 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 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	120,124,219.54	134,979,318.81
其中：支付销售机构的客户维护费	24,547,889.13	28,734,572.62

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 2014年1月1日至2014年12 月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	20,020,703.33	22,496,553.16
----------------	---------------	---------------

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	
	2014年1月1日至2014年12月31日		2013年1月1日至2013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	634,001,672.57	4,648,159.81	481,010,336.93	4,378,367.56

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2014 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 盘单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000009	中国宝安	2014-12-29	重大事项	12.95	2015-01-07	13.88	522,210.00	7,033,584.13	6,762,619.50	
000426	兴业矿业	2014-12-11	重大资产重组	11.95	2015-03-25	13.15	335,300.00	4,094,163.38	4,006,835.00	
000501	鄂武商A	2014-12-24	重大事项	15.82	2015-01-16	17.20	567,240.00	8,144,619.21	8,973,736.80	
000533	万家乐	2014-10-14	重大事项	5.97	2015-01-08	5.37	1,194,700.00	5,301,880.97	7,132,359.00	
000558	莱茵置业	2014-11-17	重大资产重组	5.97	2015-01-14	5.37	169,938.00	1,031,212.97	1,014,529.86	
000584	友利控股	2014-09-22	重大资产重组	6.85	-	-	596,300.00	3,577,050.52	4,084,655.00	
000609	绵世股份	2014-12-01	重大事项	13.87	2015-01-29	15.00	367,701.00	4,854,761.37	5,100,012.87	
000612	焦作万方	2014-12-29	重大事项	10.10	2015-01-16	10.20	1,270,944.00	12,165,543.70	12,836,534.40	
000615	湖北金环	2014-10-27	重大事项	9.75	2015-03-16	10.73	115,301.00	1,112,712.57	1,124,184.75	
000616	亿城投资	2014-12-01	重大事项	4.77	-	-	171,600.00	722,166.14	818,532.00	
000627	天茂集团	2014-10-22	重大事项	4.10	2015-01-16	4.51	2,228,740.00	7,109,297.67	9,137,834.00	
000883	湖北能源	2014-11-17	重大事项	6.43	-	-	414,000.00	2,780,410.00	2,662,020.00	
000897	津滨发展	2014-12-26	重大事项	7.55	2015-01-21	7.50	454,720.00	2,725,967.18	3,433,136.00	
002050	三花股份	2014-10-27	重大事项	13.57	2015-01-27	14.93	223,300.00	3,028,509.40	3,030,181.00	
002068	黑猫股份	2014-12-30	重大事项	8.71	2015-01-09	7.96	819,724.00	5,395,307.43	7,139,796.04	
002137	实益达	2014-12-26	重大事项	6.97	2015-01-14	7.60	640,810.00	5,857,367.86	4,466,445.70	
002152	广电运通	2014-12-17	重大事项	22.15	2015-03-11	24.37	536,528.00	9,911,689.06	11,884,095.20	
002157	正邦科技	2014-11-19	重大事项	10.03	2015-03-16	11.03	1,623,261.00	14,953,012.02	16,281,307.83	
002171	精诚铜业	2014-11-24	重大资产重组	13.07	-	-	11,518.00	126,091.65	150,540.26	
002184	海得控制	2014-11-27	重大事项	21.82	2015-01-26	20.00	26,768.00	391,709.27	584,077.76	
002308	威创股份	2014-12-29	重大事项	8.25	2015-02-04	9.08	1,242,696.00	10,588,585.55	10,252,242.00	
002323	中联电气	2014-10-22	重大资产重组	21.95	2015-01-21	24.15	190,101.00	3,185,264.19	4,172,716.95	
002425	凯撒股份	2014-12-31	重大资产重组	10.80	2015-01-08	11.88	515,940.00	5,797,827.04	5,572,152.00	
002437	誉衡药业	2014-11-21	重大事项	23.75	2015-01-26	24.70	265,700.00	6,261,621.71	6,310,375.00	
002482	广田股份	2014-12-10	重大事项	15.13	2015-01-06	16.64	471,840.00	7,216,284.46	7,138,939.20	
002558	世纪游轮	2014-10-27	重大资产重组	31.65	-	-	24,213.00	723,425.35	766,341.45	
002617	露笑科技	2014-12-01	重大事项	23.41	-	-	226,219.00	5,110,248.79	5,295,786.79	

002663	普邦园林	2014-12-09	重大资产重组	14.40	2015-03-17	15.84	507,489.00	7,099,701.13	7,307,841.60
300009	安科生物	2014-12-15	重大资产重组	17.82	2015-03-18	19.60	1,160,082.00	20,861,983.83	20,672,661.24
300044	赛为智能	2014-12-30	重大事项	13.15	2015-01-05	12.20	332,170.00	5,901,605.96	4,368,035.50
300071	华谊嘉信	2014-12-29	重大资产重组	16.40	2015-01-30	16.00	769,041.00	13,942,526.78	12,612,272.40
300143	星河生物	2014-11-27	重大事项	12.76	2015-01-07	11.48	289,524.00	3,509,080.72	3,694,326.24
300144	宋城演艺	2014-12-18	重大资产重组	27.38	2015-03-18	33.13	217,974.00	5,630,411.02	5,968,128.12
300156	神雾环保	2014-11-20	重大事项	23.18	2015-01-28	23.17	585,193.00	10,713,826.91	13,564,773.74
300160	秀强股份	2014-10-13	重大事项	16.35	2015-01-05	14.72	269,901.00	3,005,341.37	4,412,881.35
300168	万达信息	2014-12-31	重大事项	46.20	2015-01-08	44.50	196,616.00	6,600,091.59	9,083,659.20
300170	汉得信息	2014-12-10	重大事项	13.22	2015-01-28	14.54	1,478,080.00	20,366,212.47	19,540,217.60
300196	长海股份	2014-12-18	重大资产重组	23.51	2015-02-16	21.33	248,145.00	5,021,366.35	5,833,888.95
300208	恒顺电气	2014-12-17	重大事项	13.36	2015-02-09	14.70	519,400.00	6,028,972.56	6,939,184.00
300244	迪安诊断	2014-10-13	重大事项	43.93	2015-01-09	44.00	471,004.00	19,894,987.86	20,691,205.72
300347	泰格医药	2014-12-11	重大事项	30.22	2015-01-22	33.24	388,261.00	13,659,064.66	11,733,247.42
600035	楚天高速	2014-12-22	重大事项	4.51	-	-	676,671.00	2,454,361.45	3,051,786.21
600103	青山纸业	2014-10-13	重大事项	3.66	2015-02-12	4.03	3,045,500.00	8,674,145.73	11,146,530.00
600105	永鼎股份	2014-10-13	重大事项	9.86	2015-01-16	10.67	86,621.00	770,976.93	854,083.06
600129	太极集团	2014-12-17	重大资产重组	16.98	-	-	227,501.00	3,863,419.87	3,862,966.98
600236	桂冠电力	2014-12-04	重大资产重组	4.70	2015-01-30	5.17	1,541,900.00	6,332,716.37	7,246,930.00
600240	华业地产	2014-10-16	重大资产重组	7.19	2015-01-22	7.91	2,441,081.00	15,773,776.36	17,551,372.39
600288	大恒科技	2014-10-24	重大事项	10.30	2015-01-16	11.33	687,200.00	7,786,292.49	7,078,160.00
600291	西水股份	2014-12-30	重大事项	19.77	2015-01-22	21.75	386,079.00	7,219,736.54	7,632,781.83
600318	巢东股份	2014-09-30	重大资产重组	11.20	2015-02-06	12.32	1,220,858.00	12,863,539.75	13,673,609.60
600423	柳化股份	2014-12-19	重大事项	5.95	2015-03-20	6.55	1,838,602.00	10,918,862.06	10,939,681.90
600428	中远航运	2014-12-23	重大事项	7.33	2015-01-08	8.30	1,419,959.00	6,484,070.65	10,408,299.47
600487	亨通光电	2014-10-30	重大事项	18.95	2015-01-19	20.60	389,500.00	6,826,139.86	7,381,025.00
600490	鹏欣资源	2014-12-24	重大事项	10.79	2015-01-12	11.87	214,657.00	3,062,784.26	2,316,149.03
600580	卧龙电气	2014-12-08	重大事项	10.48	2015-01-14	11.12	606,000.00	5,602,168.40	6,350,880.00
600584	长电科技	2014-11-04	重大事项	11.13	2015-01-14	12.24	656,141.00	7,205,102.00	7,302,849.33
600619	海立股份	2014-11-17	重大事项	9.24	2015-01-26	10.16	384,600.00	3,235,866.36	3,553,704.00
600649	城投控股	2014-11-03	重大资产重组	7.23	-	-	330,600.00	2,351,869.13	2,390,238.00
600664	哈药股份	2014-12-31	重大事项	8.68	2015-02-17	9.45	382,304.00	3,321,353.75	3,318,398.72
600704	物产中大	2014-10-13	重大资产重组	10.38	2015-02-13	11.42	579,900.00	5,495,915.61	6,019,362.00

600754	锦江股份	2014-11-10	重大资产重组	25.11	2015-01-19	24.15	82,699.00	1,662,484.40	2,076,571.89
600759	洲际油气	2014-12-24	重大资产重组	9.90	-	-	420,531.00	5,048,220.32	4,163,256.90
600761	安徽合力	2014-12-26	重大事项	15.65	2015-01-06	16.60	1,224,531.00	14,290,711.47	19,163,910.15
600829	三精制药	2014-12-31	重大资产重组	11.82	2015-03-04	13.00	1,630,796.00	15,213,026.89	19,276,008.72
600844	丹化科技	2014-12-15	重大事项	7.60	2015-01-07	8.25	554,810.00	3,955,527.42	4,216,556.00
601519	大智慧	2014-07-21	重大事项	5.98	2015-01-23	6.58	40,500.00	245,595.00	242,190.00
603008	喜临门	2014-11-17	重大资产重组	15.27	2015-03-13	16.04	323,600.00	3,377,869.17	4,941,372.00

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 2014 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 2014 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等级的证券，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 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
利率敏感度缺口	668,623,565.33	-	-	-	-	7,448,028,842.04	8,116,652,407.37
上年度末 2013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	481,010,336.93	-	-	-	-	-	481,010,336.93
结算备付金	9,476,999.02	-	-	-	-	-	9,476,999.02
存出保证金	1,626,242.24	-	-	-	-	-	1,626,242.24
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,530,218,518.47	8,530,218,518.47
应收证券清算款	-	-	-	-	-	80,545,526.57	80,545,526.57
应收利息	-	-	-	-	-	104,716.52	104,716.52
应收申购款	705.71	-	-	-	-	259,638.94	260,344.65
资产总计	492,114,283.90	-	-	-	-	8,611,128,400.50	9,103,242,684.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,776,488.11	9,776,488.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,794,431.37	11,794,431.37
应付托管费	-	-	-	-	-	1,965,738.57	1,965,738.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,093,239.90	6,093,239.90
其他负债	-	-	-	-	-	748,153.51	748,153.51
负债总计	-	-	-	-	-	30,378,051.46	30,378,051.46
利率敏感度缺口	492,114,283.90	-	-	-	-	8,580,750,349.04	9,072,864,632.94

--	--	--	--	--	--	--	--

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 2014 年 12 月 31 日		上年度末 2013 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	7,508,779,565.78	92.51	8,530,218,518.47	94.02
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	7,508,779,565.78	92.51	8,530,218,518.47	94.02

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其过去一年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 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 6,393	增加约 9,270
	业绩比较基准下降 1%	减少约 6,393	减少约 9,270

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 2014 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于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（于 2013 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 8,414,988,580.72 元，属于第二层次的余额为人民币 115,229,937.75 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(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。

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 2015 年 3 月 26 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	7,508,779,565.78	91.81
	其中：股票	7,508,779,565.78	91.81
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	666,529,967.06	8.15
7	其他各项资产	3,463,624.82	0.04

8	合计	8,178,773,157.66	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	79,409,371.63	0.98
B	采矿业	269,075,091.47	3.32
C	制造业	3,717,607,599.37	45.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	334,948,178.67	4.13
E	建筑业	279,776,296.69	3.45
F	批发和零售业	332,385,162.81	4.10
G	交通运输、仓储和邮政业	271,073,140.80	3.34
H	住宿和餐饮业	2,076,571.89	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	298,153,064.32	3.67
J	金融业	1,174,951,891.97	14.48
K	房地产业	486,449,651.58	5.99
L	租赁和商务服务业	63,735,497.45	0.79
M	科学研究和技术服务业	12,482,817.74	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	47,430,185.57	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	37,648,153.54	0.46
R	文化、体育和娱乐业	76,383,784.41	0.94
S	综合	25,193,105.87	0.31
	合计	7,508,779,565.78	92.51

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	1,541,923	115,197,067.33	1.42
2	600016	民生银行	9,650,064	104,992,696.32	1.29
3	600036	招商银行	5,109,713	84,770,138.67	1.04
4	600000	浦发银行	5,215,412	81,829,814.28	1.01
5	600837	海通证券	2,924,313	70,358,970.78	0.87
6	600030	中信证券	2,011,448	68,188,087.20	0.84
7	600886	国投电力	5,341,043	61,101,531.92	0.75
8	601628	中国人寿	1,763,277	60,215,909.55	0.74
9	601166	兴业银行	3,472,642	57,298,593.00	0.71
10	600104	上汽集团	2,099,115	45,067,999.05	0.56
11	601668	中国建筑	5,611,976	40,855,185.28	0.50
12	601288	农业银行	10,303,344	38,225,406.24	0.47
13	000002	万科A	2,670,161	37,115,237.90	0.46
14	601006	大秦铁路	3,369,273	35,916,450.18	0.44
15	601328	交通银行	5,220,755	35,501,134.00	0.44
16	600376	首开股份	3,409,286	34,365,602.88	0.42
17	601988	中国银行	8,095,430	33,596,034.50	0.41
18	601398	工商银行	6,856,283	33,390,098.21	0.41
19	601088	中国神华	1,612,489	32,717,401.81	0.40
20	000425	徐工机械	2,183,880	32,692,683.60	0.40
21	600887	伊利股份	1,103,242	31,585,818.46	0.39
22	600028	中国石化	4,662,136	30,257,262.64	0.37
23	300182	捷成股份	1,666,430	29,829,097.00	0.37
24	601169	北京银行	2,720,895	29,739,382.35	0.37
25	600019	宝钢股份	4,230,453	29,655,475.53	0.37
26	601601	中国太保	856,069	27,651,028.70	0.34
27	600015	华夏银行	2,049,019	27,579,795.74	0.34
28	000001	平安银行	1,672,809	26,497,294.56	0.33
29	601555	东吴证券	1,175,109	26,345,943.78	0.32
30	600109	国金证券	1,326,101	26,243,538.79	0.32
31	600741	华域汽车	1,691,910	26,190,766.80	0.32
32	000625	长安汽车	1,547,717	25,428,990.31	0.31
33	600519	贵州茅台	133,728	25,357,503.36	0.31
34	600583	海油工程	2,380,261	25,064,148.33	0.31
35	600588	用友软件	1,065,404	25,026,339.96	0.31
36	002429	兆驰股份	3,236,319	24,596,024.40	0.30
37	600697	欧亚集团	952,346	24,522,909.50	0.30
38	601939	建设银行	3,597,091	24,208,422.43	0.30
39	300004	南风股份	590,760	24,150,268.80	0.30
40	000878	云南铜业	1,678,828	23,973,663.84	0.30
41	601618	中国中冶	4,675,315	23,610,340.75	0.29

42	600006	东风汽车	3,962,056	23,574,233.20	0.29
43	600048	保利地产	2,173,550	23,517,811.00	0.29
44	601010	文峰股份	2,273,339	22,847,056.95	0.28
45	600566	洪城股份	1,154,739	22,748,358.30	0.28
46	002202	金风科技	1,594,306	22,527,543.78	0.28
47	601012	隆基股份	1,069,782	22,294,256.88	0.27
48	601857	中国石油	2,053,774	22,201,296.94	0.27
49	000776	广发证券	854,625	22,177,518.75	0.27
50	002595	豪迈科技	889,803	22,067,114.40	0.27
51	000418	小天鹅 A	1,675,364	21,913,761.12	0.27
52	002028	思源电气	1,744,376	21,717,481.20	0.27
53	600674	川投能源	1,044,738	21,657,418.74	0.27
54	601390	中国中铁	2,328,729	21,657,179.70	0.27
55	002332	仙琚制药	1,962,986	21,396,547.40	0.26
56	601688	华泰证券	870,518	21,301,575.46	0.26
57	600219	南山铝业	2,386,453	21,167,838.11	0.26
58	600004	白云机场	1,910,873	20,885,841.89	0.26
59	300244	迪安诊断	471,004	20,691,205.72	0.25
60	300009	安科生物	1,160,082	20,672,661.24	0.25
61	600252	中恒集团	1,261,702	20,641,444.72	0.25
62	300251	光线传媒	866,767	20,490,371.88	0.25
63	000951	中国重汽	988,001	20,431,860.68	0.25
64	601898	中煤能源	2,900,000	20,068,000.00	0.25
65	600266	北京城建	838,743	19,844,659.38	0.24
66	002311	海大集团	1,604,066	19,697,930.48	0.24
67	600657	信达地产	2,405,388	19,627,966.08	0.24
68	300170	汉得信息	1,478,080	19,540,217.60	0.24
69	600829	三精制药	1,630,796	19,276,008.72	0.24
70	600761	安徽合力	1,224,531	19,163,910.15	0.24
71	600426	华鲁恒升	1,731,577	18,943,452.38	0.23
72	600900	长江电力	1,752,649	18,700,764.83	0.23
73	000830	鲁西化工	3,447,547	18,616,753.80	0.23
74	600720	祁连山	1,679,028	18,418,937.16	0.23
75	601179	中国西电	2,369,317	18,409,593.09	0.23
76	600197	伊力特	1,498,430	18,400,720.40	0.23
77	300202	聚龙股份	592,555	18,304,023.95	0.23
78	002294	信立泰	516,021	18,292,944.45	0.23
79	002508	老板电器	558,179	18,196,635.40	0.22
80	002048	宁波华翔	1,260,989	18,120,411.93	0.22
81	600216	浙江医药	1,668,372	18,118,519.92	0.22
82	002008	大族激光	1,126,827	17,995,427.19	0.22
83	600858	银座股份	1,781,418	17,921,065.08	0.22
84	600873	梅花生物	2,480,952	17,763,616.32	0.22
85	600585	海螺水泥	799,045	17,642,913.60	0.22

86	600240	华业地产	2,441,081	17,551,372.39	0.22
87	600491	龙元建设	2,613,660	17,485,385.40	0.22
88	000422	湖北宜化	2,327,500	17,432,975.00	0.21
89	002400	省广股份	797,230	17,275,974.10	0.21
90	601377	兴业证券	1,135,021	17,161,517.52	0.21
91	600782	新钢股份	2,697,332	16,966,218.28	0.21
92	000021	长城开发	2,354,660	16,906,458.80	0.21
93	600999	招商证券	594,789	16,814,685.03	0.21
94	601866	中海集运	3,390,945	16,751,268.30	0.21
95	600183	生益科技	2,087,102	16,655,073.96	0.21
96	600340	华夏幸福	381,441	16,630,827.60	0.20
97	600050	中国联通	3,339,217	16,529,124.15	0.20
98	000962	东方钽业	1,418,822	16,515,088.08	0.20
99	600888	新疆众和	2,067,634	16,499,719.32	0.20
100	000488	晨鸣纸业	2,666,077	16,449,695.09	0.20
101	002157	正邦科技	1,623,261	16,281,307.83	0.20
102	002039	黔源电力	1,140,486	16,263,330.36	0.20
103	600780	通宝能源	2,407,917	16,229,360.58	0.20
104	600111	包钢稀土	624,788	16,169,513.44	0.20
105	300113	顺网科技	788,075	15,887,592.00	0.20
106	601901	方正证券	1,114,730	15,706,545.70	0.19
107	600510	黑牡丹	2,000,784	15,426,044.64	0.19
108	000869	张裕 A	437,985	15,268,157.10	0.19
109	600770	综艺股份	1,757,649	15,221,240.34	0.19
110	300199	翰宇药业	552,497	14,917,419.00	0.18
111	300075	数字政通	588,076	14,895,965.08	0.18
112	600547	山东黄金	745,058	14,789,401.30	0.18
113	000333	美的集团	533,118	14,628,757.92	0.18
114	000783	长江证券	868,038	14,600,399.16	0.18
115	601678	滨化股份	1,399,241	14,538,113.99	0.18
116	000429	粤高速 A	2,922,897	14,439,111.18	0.18
117	300045	华力创通	847,287	14,378,460.39	0.18
118	000063	中兴通讯	793,112	14,323,602.72	0.18
119	000671	阳光城	1,032,661	14,323,008.07	0.18
120	000963	华东医药	269,333	14,169,609.13	0.17
121	600742	一汽富维	503,566	14,125,026.30	0.17
122	000066	长城电脑	2,439,212	13,976,684.76	0.17
123	600326	西藏天路	1,557,455	13,923,647.70	0.17
124	601099	太平洋	973,305	13,840,397.10	0.17
125	600811	东方集团	1,450,152	13,776,444.00	0.17
126	600318	巢东股份	1,220,858	13,673,609.60	0.17
127	600395	盘江股份	1,140,305	13,592,435.60	0.17
128	000780	平庄能源	2,214,796	13,576,699.48	0.17
129	601616	广电电气	2,635,631	13,573,499.65	0.17

130	300156	神雾环保	585,193	13,564,773.74	0.17
131	002083	孚日股份	2,737,713	13,496,925.09	0.17
132	000037	深南电 A	1,776,177	13,481,183.43	0.17
133	000768	中航飞机	705,610	13,364,253.40	0.16
134	000540	中天城投	1,122,742	13,225,900.76	0.16
135	002299	圣农发展	1,032,054	13,055,483.10	0.16
136	000929	兰州黄河	1,245,944	12,932,898.72	0.16
137	000612	焦作万方	1,270,944	12,836,534.40	0.16
138	601005	重庆钢铁	3,849,075	12,817,419.75	0.16
139	600226	升华拜克	1,551,519	12,769,001.37	0.16
140	002321	华英农业	1,680,134	12,752,217.06	0.16
141	600823	世茂股份	864,078	12,710,587.38	0.16
142	600290	华仪电气	1,258,213	12,645,040.65	0.16
143	300001	特锐德	679,645	12,634,600.55	0.16
144	300071	华谊嘉信	769,041	12,612,272.40	0.16
145	000651	格力电器	335,520	12,454,502.40	0.15
146	600029	南方航空	2,408,191	12,426,265.56	0.15
147	601333	广深铁路	2,743,863	12,402,260.76	0.15
148	600398	海澜之家	1,227,441	12,397,154.10	0.15
149	600779	水井坊	1,268,335	12,391,632.95	0.15
150	002078	太阳纸业	3,047,983	12,374,810.98	0.15
151	600606	金丰投资	956,173	12,372,878.62	0.15
152	600655	豫园商城	1,045,197	12,354,228.54	0.15
153	300017	网宿科技	255,677	12,323,631.40	0.15
154	600724	宁波富达	2,059,577	12,295,674.69	0.15
155	603993	洛阳钼业	1,403,673	12,282,138.75	0.15
156	300058	蓝色光标	580,984	12,270,382.08	0.15
157	600284	浦东建设	1,051,302	12,216,129.24	0.15
158	600795	国电电力	2,621,764	12,138,767.32	0.15
159	000718	苏宁环球	1,788,050	12,033,576.50	0.15
160	002345	潮宏基	1,430,159	12,013,335.60	0.15
161	000566	海南海药	784,665	11,942,601.30	0.15
162	600409	三友化工	1,928,692	11,900,029.64	0.15
163	002152	广电运通	536,528	11,884,095.20	0.15
164	600694	大商股份	247,910	11,882,326.30	0.15
165	600702	沱牌舍得	635,347	11,836,514.61	0.15
166	600201	金宇集团	336,313	11,797,860.04	0.15
167	002427	尤夫股份	1,010,882	11,796,992.94	0.15
168	300052	中青宝	578,110	11,764,538.50	0.14
169	300347	泰格医药	388,261	11,733,247.42	0.14
170	600176	中国玻纤	749,331	11,592,150.57	0.14
171	600066	宇通客车	518,927	11,587,639.91	0.14
172	600202	哈空调	1,511,182	11,560,542.30	0.14
173	000759	中百集团	1,287,568	11,472,230.88	0.14

174	000961	中南建设	831,857	11,396,440.90	0.14
175	000798	中水渔业	1,227,625	11,392,360.00	0.14
176	601336	新华保险	229,752	11,386,509.12	0.14
177	000096	广聚能源	1,431,082	11,334,169.44	0.14
178	600345	长江通信	747,117	11,259,053.19	0.14
179	600533	栖霞建设	2,237,757	11,188,785.00	0.14
180	600726	华电能源	2,465,102	11,166,912.06	0.14
181	600103	青山纸业	3,045,500	11,146,530.00	0.14
182	000939	凯迪电力	989,388	11,130,615.00	0.14
183	002603	以岭药业	377,223	10,999,822.68	0.14
184	600750	江中药业	542,500	10,985,625.00	0.14
185	601233	桐昆股份	1,035,799	10,979,469.40	0.14
186	300153	科泰电源	821,048	10,960,990.80	0.14
187	600423	柳化股份	1,838,602	10,939,681.90	0.13
188	000900	现代投资	1,553,906	10,908,420.12	0.13
189	600496	精工钢构	1,146,545	10,880,712.05	0.13
190	002714	牧原股份	247,137	10,874,028.00	0.13
191	000868	安凯客车	1,886,100	10,807,353.00	0.13
192	002470	金正大	401,096	10,789,482.40	0.13
193	600175	美都能源	2,079,633	10,710,109.95	0.13
194	000960	锡业股份	613,915	10,682,121.00	0.13
195	000729	燕京啤酒	1,328,060	10,611,199.40	0.13
196	002080	中材科技	813,296	10,572,848.00	0.13
197	600303	曙光股份	1,771,808	10,542,257.60	0.13
198	601929	吉视传媒	913,360	10,485,372.80	0.13
199	002254	泰和新材	913,825	10,454,158.00	0.13
200	600428	中远航运	1,419,959	10,408,299.47	0.13
201	000060	中金岭南	1,090,021	10,344,299.29	0.13
202	002125	湘潭电化	999,153	10,341,233.55	0.13
203	002572	索菲亚	483,006	10,336,328.40	0.13
204	600356	恒丰纸业	1,294,625	10,331,107.50	0.13
205	600018	上港集团	1,607,312	10,318,943.04	0.13
206	300179	四方达	987,122	10,315,424.90	0.13
207	601098	中南传媒	617,997	10,258,750.20	0.13
208	002308	威创股份	1,242,696	10,252,242.00	0.13
209	300032	金龙机电	553,457	10,238,954.50	0.13
210	600889	南京化纤	1,261,751	10,232,800.61	0.13
211	000818	方大化工	2,368,375	10,231,380.00	0.13
212	000100	TCL 集团	2,686,195	10,207,541.00	0.13
213	600026	中海发展	1,119,795	10,190,134.50	0.13
214	601989	中国重工	1,102,671	10,155,599.91	0.13
215	600719	大连热电	1,170,564	10,125,378.60	0.12
216	002092	中泰化学	1,305,990	10,121,422.50	0.12
217	000707	双环科技	1,964,976	10,119,626.40	0.12

218	600141	兴发集团	663,935	10,118,369.40	0.12
219	000886	海南高速	2,068,644	10,115,669.16	0.12
220	600573	惠泉啤酒	1,109,803	10,099,207.30	0.12
221	601965	中国汽研	823,177	10,075,686.48	0.12
222	600531	豫光金铅	749,397	10,049,413.77	0.12
223	600068	葛洲坝	1,075,521	10,034,610.93	0.12
224	600171	上海贝岭	947,077	10,010,603.89	0.12
225	600569	安阳钢铁	3,005,483	10,008,258.39	0.12
226	000877	天山股份	976,405	10,008,151.25	0.12
227	601009	南京银行	681,362	9,981,953.30	0.12
228	600069	银鸽投资	2,113,368	9,975,096.96	0.12
229	600865	百大集团	1,298,809	9,974,853.12	0.12
230	000876	新希望	711,648	9,963,072.00	0.12
231	002250	联化科技	668,682	9,896,493.60	0.12
232	002444	巨星科技	880,731	9,864,187.20	0.12
233	002458	益生股份	833,497	9,843,599.57	0.12
234	300138	晨光生物	891,541	9,806,951.00	0.12
235	002156	通富微电	1,222,323	9,803,030.46	0.12
236	600271	航天信息	320,873	9,789,835.23	0.12
237	600058	五矿发展	558,491	9,751,252.86	0.12
238	300082	奥克股份	747,477	9,732,150.54	0.12
239	002557	洽洽食品	514,568	9,730,480.88	0.12
240	002483	润邦股份	856,410	9,728,817.60	0.12
241	002420	毅昌股份	1,449,460	9,711,382.00	0.12
242	000957	中通客车	721,978	9,710,604.10	0.12
243	600177	雅戈尔	836,936	9,633,133.36	0.12
244	600020	中原高速	2,369,555	9,620,393.30	0.12
245	300072	三聚环保	397,821	9,619,311.78	0.12
246	002153	石基信息	146,530	9,612,368.00	0.12
247	600801	华新水泥	905,526	9,589,520.34	0.12
248	600884	杉杉股份	575,324	9,544,625.16	0.12
249	000656	金科股份	612,460	9,493,130.00	0.12
250	600079	人福医药	368,994	9,464,696.10	0.12
251	600370	三房巷	1,420,902	9,448,998.30	0.12
252	601800	中国交建	677,840	9,415,197.60	0.12
253	000631	顺发恒业	1,493,707	9,395,417.03	0.12
254	300332	天壕节能	710,486	9,300,261.74	0.11
255	600690	青岛海尔	500,000	9,280,000.00	0.11
256	600052	浙江广厦	1,448,184	9,268,377.60	0.11
257	002479	富春环保	1,018,221	9,245,446.68	0.11
258	600366	宁波韵升	569,408	9,195,939.20	0.11
259	000627	天茂集团	2,228,740	9,137,834.00	0.11
260	300168	万达信息	196,616	9,083,659.20	0.11
261	600350	山东高速	1,798,045	9,062,146.80	0.11

262	300092	科新机电	551,461	9,049,475.01	0.11
263	601126	四方股份	522,817	9,044,734.10	0.11
264	000006	深振业 A	1,280,249	9,025,755.45	0.11
265	600012	皖通高速	1,455,131	8,992,709.58	0.11
266	000501	鄂武商 A	567,240	8,973,736.80	0.11
267	002498	汉缆股份	1,096,613	8,959,328.21	0.11
268	000550	江铃汽车	295,391	8,950,347.30	0.11
269	000603	盛达矿业	729,306	8,941,291.56	0.11
270	002194	武汉凡谷	833,570	8,919,199.00	0.11
271	300115	长盈精密	491,135	8,904,277.55	0.11
272	000090	天健集团	642,701	8,869,273.80	0.11
273	600162	香江控股	1,347,400	8,704,204.00	0.11
274	000400	许继电气	425,598	8,639,639.40	0.11
275	600893	航空动力	296,240	8,579,110.40	0.11
276	300055	万邦达	192,140	8,571,365.40	0.11
277	601998	中信银行	1,046,788	8,520,854.32	0.10
278	600743	华远地产	1,827,499	8,443,045.38	0.10
279	300256	星星科技	567,869	8,421,497.27	0.10
280	601117	中国化学	889,520	8,405,964.00	0.10
281	601139	深圳燃气	1,017,208	8,391,966.00	0.10
282	002408	齐翔腾达	513,183	8,385,410.22	0.10
283	600372	中航电子	302,432	8,374,342.08	0.10
284	000027	深圳能源	748,614	8,354,532.24	0.10
285	600060	海信电器	728,952	8,331,921.36	0.10
286	600859	王府井	375,122	8,320,205.96	0.10
287	600377	宁沪高速	1,137,966	8,307,151.80	0.10
288	300203	聚光科技	432,216	8,289,902.88	0.10
289	002357	富临运业	679,355	8,247,369.70	0.10
290	601992	金隅股份	812,319	8,236,914.66	0.10
291	002293	罗莱家纺	319,449	8,229,006.24	0.10
292	000893	东凌粮油	768,473	8,199,606.91	0.10
293	000828	东莞控股	1,005,978	8,198,720.70	0.10
294	300212	易华录	297,547	8,194,444.38	0.10
295	300029	天龙光电	1,011,221	8,150,441.26	0.10
296	300124	汇川技术	278,902	8,141,149.38	0.10
297	601933	永辉超市	933,351	8,129,487.21	0.10
298	000807	云铝股份	1,459,184	8,054,695.68	0.10
299	002292	奥飞动漫	272,794	8,047,423.00	0.10
300	600064	南京高科	445,566	8,015,732.34	0.10
301	300070	碧水源	229,209	7,976,473.20	0.10
302	002475	立讯精密	288,099	7,974,580.32	0.10
303	600289	亿阳信通	798,683	7,906,961.70	0.10
304	300148	天舟文化	443,923	7,906,268.63	0.10
305	300298	三诺生物	249,827	7,859,557.42	0.10

306	600851	海欣股份	904,056	7,856,246.64	0.10
307	300024	机器人	198,094	7,802,922.66	0.10
308	600131	岷江水电	1,175,889	7,784,385.18	0.10
309	600879	航天电子	498,425	7,775,430.00	0.10
310	600563	法拉电子	265,307	7,646,147.74	0.09
311	600291	西水股份	386,079	7,632,781.83	0.09
312	600095	哈高科	1,216,921	7,630,094.67	0.09
313	600582	天地科技	622,524	7,588,567.56	0.09
314	002191	劲嘉股份	552,668	7,577,078.28	0.09
315	000728	国元证券	242,679	7,564,304.43	0.09
316	600518	康美药业	479,419	7,536,466.68	0.09
317	000713	丰乐种业	729,433	7,527,748.56	0.09
318	600850	华东电脑	211,053	7,521,928.92	0.09
319	600597	光明乳业	429,130	7,492,609.80	0.09
320	002206	海利得	921,946	7,430,884.76	0.09
321	000727	华东科技	975,570	7,424,087.70	0.09
322	002062	宏润建设	1,229,423	7,413,420.69	0.09
323	601339	百隆东方	698,671	7,405,912.60	0.09
324	600487	亨通光电	389,500	7,381,025.00	0.09
325	600551	时代出版	451,964	7,326,336.44	0.09
326	600806	昆明机床	1,000,292	7,322,137.44	0.09
327	002663	普邦园林	507,489	7,307,841.60	0.09
328	600584	长电科技	656,141	7,302,849.33	0.09
329	000581	威孚高科	271,345	7,280,186.35	0.09
330	000850	华茂股份	947,541	7,267,639.47	0.09
331	600236	桂冠电力	1,541,900	7,246,930.00	0.09
332	300204	舒泰神	298,838	7,246,821.50	0.09
333	002142	宁波银行	460,149	7,238,143.77	0.09
334	600460	士兰微	1,264,116	7,218,102.36	0.09
335	000860	顺鑫农业	384,835	7,188,717.80	0.09
336	000680	山推股份	949,656	7,169,902.80	0.09
337	002237	恒邦股份	441,730	7,160,443.30	0.09
338	000525	红太阳	450,816	7,154,449.92	0.09
339	000885	同力水泥	649,286	7,142,146.00	0.09
340	002068	黑猫股份	819,724	7,139,796.04	0.09
341	002482	广田股份	471,840	7,138,939.20	0.09
342	000533	万家乐	1,194,700	7,132,359.00	0.09
343	002024	苏宁云商	791,723	7,125,507.00	0.09
344	000726	鲁泰A	592,445	7,103,415.55	0.09
345	600288	大恒科技	687,200	7,078,160.00	0.09
346	600894	广日股份	548,989	7,054,508.65	0.09
347	600872	中炬高新	669,142	6,945,693.96	0.09
348	300208	恒顺电气	519,400	6,939,184.00	0.09
349	600312	平高电气	463,417	6,877,108.28	0.08

350	600246	万通地产	1,418,627	6,866,154.68	0.08
351	601958	金钼股份	731,984	6,858,690.08	0.08
352	600017	日照港	1,471,643	6,843,139.95	0.08
353	002493	荣盛石化	564,134	6,842,945.42	0.08
354	000758	中色股份	463,709	6,811,885.21	0.08
355	002056	横店东磁	310,151	6,807,814.45	0.08
356	002419	天虹商场	500,302	6,799,104.18	0.08
357	300207	欣旺达	263,855	6,783,712.05	0.08
358	600335	国机汽车	377,317	6,765,293.81	0.08
359	600570	恒生电子	123,516	6,763,736.16	0.08
360	000620	新华联	917,588	6,762,623.56	0.08
361	000009	中国宝安	522,210	6,762,619.50	0.08
362	300146	汤臣倍健	259,150	6,737,900.00	0.08
363	300273	和佳股份	286,937	6,642,591.55	0.08
364	002063	远光软件	328,604	6,588,510.20	0.08
365	600308	华泰股份	1,434,691	6,585,231.69	0.08
366	002489	浙江永强	483,324	6,568,373.16	0.08
367	000975	银泰资源	427,829	6,541,505.41	0.08
368	600351	亚宝药业	746,143	6,513,828.39	0.08
369	002088	鲁阳股份	486,865	6,499,647.75	0.08
370	002140	东华科技	360,238	6,480,681.62	0.08
371	002233	塔牌集团	635,776	6,465,841.92	0.08
372	002399	海普瑞	250,326	6,458,410.80	0.08
373	002081	金螳螂	384,314	6,456,475.20	0.08
374	601799	星宇股份	347,163	6,446,816.91	0.08
375	002372	伟星新材	405,696	6,409,996.80	0.08
376	000548	湖南投资	834,009	6,396,849.03	0.08
377	002219	恒康医疗	334,598	6,374,091.90	0.08
378	600580	卧龙电气	606,000	6,350,880.00	0.08
379	002437	誉衡药业	265,700	6,310,375.00	0.08
380	600298	安琪酵母	341,603	6,305,991.38	0.08
381	000039	中集集团	287,100	6,284,619.00	0.08
382	000792	盐湖股份	289,534	6,282,887.80	0.08
383	300133	华策影视	250,510	6,282,790.80	0.08
384	002317	众生药业	325,995	6,259,104.00	0.08
385	601991	大唐发电	909,630	6,258,254.40	0.08
386	600832	东方明珠	451,942	6,254,877.28	0.08
387	601677	明泰铝业	487,795	6,253,531.90	0.08
388	600978	宜华木业	1,035,718	6,235,022.36	0.08
389	601100	恒立油缸	462,469	6,169,336.46	0.08
390	000875	吉电股份	1,242,510	6,162,849.60	0.08
391	300005	探路者	331,234	6,147,703.04	0.08
392	002238	天威视讯	437,253	6,130,287.06	0.08
393	002430	杭氧股份	699,581	6,128,329.56	0.08

394	600278	东方创业	457,725	6,096,897.00	0.08
395	000650	仁和药业	788,205	6,084,942.60	0.07
396	002060	粤水电	817,187	6,063,527.54	0.07
397	600256	广汇能源	723,986	6,052,522.96	0.07
398	002115	三维通信	682,060	6,043,051.60	0.07
399	002454	松芝股份	430,580	6,036,731.60	0.07
400	600704	物产中大	579,900	6,019,362.00	0.07
401	600337	美克家居	629,923	6,009,465.42	0.07
402	600869	智慧能源	677,537	5,975,876.34	0.07
403	000732	泰禾集团	362,866	5,969,145.70	0.07
404	300144	宋城演艺	217,974	5,968,128.12	0.07
405	600637	百视通	157,405	5,962,501.40	0.07
406	000430	张家界	733,626	5,949,706.86	0.07
407	000626	如意集团	454,523	5,922,434.69	0.07
408	300147	香雪制药	352,560	5,880,700.80	0.07
409	600054	黄山旅游	379,377	5,876,549.73	0.07
410	000538	云南白药	92,651	5,850,910.65	0.07
411	002242	九阳股份	527,920	5,844,074.40	0.07
412	300196	长海股份	248,145	5,833,888.95	0.07
413	000859	国风塑业	998,918	5,833,681.12	0.07
414	600710	常林股份	990,142	5,812,133.54	0.07
415	002701	奥瑞金	283,612	5,805,537.64	0.07
416	600802	福建水泥	636,014	5,781,367.26	0.07
417	002218	拓日新能	617,150	5,764,181.00	0.07
418	000572	海马汽车	1,093,584	5,763,187.68	0.07
419	002110	三钢闽光	935,407	5,762,107.12	0.07
420	002066	瑞泰科技	565,823	5,760,078.14	0.07
421	600320	振华重工	785,756	5,759,591.48	0.07
422	002300	太阳电缆	805,203	5,757,201.45	0.07
423	600808	马钢股份	1,432,666	5,744,990.66	0.07
424	600138	中青旅	348,125	5,730,137.50	0.07
425	300197	铁汉生态	394,294	5,729,091.82	0.07
426	000910	大亚科技	800,109	5,704,777.17	0.07
427	300257	开山股份	161,740	5,693,248.00	0.07
428	601311	骆驼股份	432,791	5,660,906.28	0.07
429	600468	百利电气	426,238	5,660,440.64	0.07
430	002246	北化股份	565,929	5,653,630.71	0.07
431	002221	东华能源	342,163	5,642,267.87	0.07
432	002190	成飞集成	176,289	5,641,248.00	0.07
433	002262	恩华药业	226,945	5,628,236.00	0.07
434	002614	蒙发利	405,171	5,623,773.48	0.07
435	002003	伟星股份	570,813	5,622,508.05	0.07
436	000553	沙隆达A	410,550	5,604,007.50	0.07
437	600635	大众公用	656,427	5,599,322.31	0.07

438	002702	海欣食品	325,670	5,598,267.30	0.07
439	000918	嘉凯城	1,288,756	5,593,201.04	0.07
440	601600	中国铝业	894,363	5,589,768.75	0.07
441	002425	凯撒股份	515,940	5,572,152.00	0.07
442	002690	美亚光电	156,314	5,564,778.40	0.07
443	600195	中牧股份	350,505	5,555,504.25	0.07
444	300129	泰胜风能	591,299	5,552,297.61	0.07
445	600776	东方通信	680,439	5,531,969.07	0.07
446	300187	永清环保	181,081	5,522,970.50	0.07
447	002610	爱康科技	329,072	5,485,630.24	0.07
448	002136	安纳达	568,492	5,474,577.96	0.07
449	000541	佛山照明	535,911	5,471,651.31	0.07
450	002588	史丹利	139,984	5,452,376.80	0.07
451	600521	华海药业	374,865	5,450,537.10	0.07
452	002100	天康生物	455,263	5,440,392.85	0.07
453	600056	中国医药	331,036	5,432,300.76	0.07
454	600651	飞乐音响	662,918	5,422,669.24	0.07
455	000965	天保基建	621,125	5,416,210.00	0.07
456	600261	阳光照明	636,653	5,398,817.44	0.07
457	002599	盛通股份	375,763	5,395,956.68	0.07
458	002241	歌尔声学	219,901	5,394,171.53	0.07
459	300177	中海达	394,157	5,380,243.05	0.07
460	600010	包钢股份	1,317,799	5,376,619.92	0.07
461	600522	中天科技	349,287	5,375,526.93	0.07
462	600170	上海建工	638,356	5,368,573.96	0.07
463	002036	宜科科技	660,210	5,367,507.30	0.07
464	002291	星期六	664,253	5,340,594.12	0.07
465	600098	广州发展	609,656	5,340,586.56	0.07
466	000597	东北制药	502,864	5,325,329.76	0.07
467	002271	东方雨虹	159,556	5,319,597.04	0.07
468	600790	轻纺城	645,325	5,298,118.25	0.07
469	002617	露笑科技	226,219	5,295,786.79	0.07
470	600593	大连圣亚	304,290	5,282,474.40	0.07
471	000969	安泰科技	578,387	5,274,889.44	0.06
472	000599	青岛双星	901,852	5,266,815.68	0.06
473	002005	德豪润达	663,384	5,260,635.12	0.06
474	300101	振芯科技	239,214	5,260,315.86	0.06
475	000926	福星股份	488,388	5,255,054.88	0.06
476	600643	爱建股份	381,113	5,228,870.36	0.06
477	300015	爱尔眼科	189,608	5,223,700.40	0.06
478	000778	新兴铸管	842,763	5,208,275.34	0.06
479	601886	江河创建	627,194	5,205,710.20	0.06
480	600307	酒钢宏兴	1,236,607	5,193,749.40	0.06
481	300303	聚飞光电	303,494	5,183,677.52	0.06

482	002144	宏达高科	298,723	5,167,907.90	0.06
483	600321	国栋建设	1,347,253	5,159,978.99	0.06
484	300240	飞力达	418,874	5,152,150.20	0.06
485	002484	江海股份	348,260	5,147,282.80	0.06
486	002450	康得新	177,625	5,145,796.25	0.06
487	000024	招商地产	194,940	5,144,466.60	0.06
488	002264	新华都	716,085	5,134,329.45	0.06
489	600747	大连控股	778,612	5,131,053.08	0.06
490	600027	华电国际	730,646	5,114,522.00	0.06
491	000609	绵世股份	367,701	5,100,012.87	0.06
492	000915	山大华特	195,460	5,097,596.80	0.06
493	600973	宝胜股份	470,071	5,057,963.96	0.06
494	002669	康达新材	390,136	5,052,261.20	0.06
495	600864	哈投股份	339,791	5,045,896.35	0.06
496	601188	龙江交通	1,123,589	5,044,914.61	0.06
497	002541	鸿路钢构	375,628	5,040,927.76	0.06
498	600449	宁夏建材	405,643	5,038,086.06	0.06
499	300079	数码视讯	404,366	5,034,356.70	0.06
500	002575	群兴玩具	417,823	5,030,588.92	0.06
501	002403	爱仕达	422,791	5,010,073.35	0.06
502	600152	维科精华	737,263	4,998,643.14	0.06
503	002550	千红制药	245,558	4,994,649.72	0.06
504	600529	山东药玻	400,704	4,992,771.84	0.06
505	600686	金龙汽车	418,457	4,988,007.44	0.06
506	002149	西部材料	319,580	4,963,077.40	0.06
507	601890	亚星锚链	494,069	4,960,452.76	0.06
508	600369	西南证券	222,437	4,958,120.73	0.06
509	603008	喜临门	323,600	4,941,372.00	0.06
510	300226	上海钢联	81,751	4,935,307.87	0.06
511	000686	东北证券	245,984	4,914,760.32	0.06
512	002626	金达威	203,842	4,914,630.62	0.06
513	002364	中恒电气	300,931	4,914,203.23	0.06
514	600082	海泰发展	715,069	4,912,524.03	0.06
515	300046	台基股份	347,997	4,899,797.76	0.06
516	600525	长园集团	425,600	4,890,144.00	0.06
517	002593	日上集团	360,155	4,854,889.40	0.06
518	600461	洪城水业	415,191	4,841,127.06	0.06
519	000030	富奥股份	570,489	4,820,632.05	0.06
520	002616	长青集团	188,190	4,808,254.50	0.06
521	600976	健民集团	175,598	4,806,117.26	0.06
522	002382	蓝帆医疗	281,387	4,803,276.09	0.06
523	002150	通润装备	591,079	4,793,650.69	0.06
524	600572	康恩贝	317,506	4,791,165.54	0.06
525	600469	风神股份	391,221	4,788,545.04	0.06

526	600620	天宸股份	512,138	4,783,368.92	0.06
527	002304	洋河股份	60,488	4,781,576.40	0.06
528	002431	棕榈园林	225,075	4,751,333.25	0.06
529	300175	朗源股份	718,469	4,741,895.40	0.06
530	600122	宏图高科	660,760	4,737,649.20	0.06
531	002395	双象股份	433,902	4,733,870.82	0.06
532	000797	中国武夷	437,112	4,720,809.60	0.06
533	600739	辽宁成大	219,346	4,713,745.54	0.06
534	002017	东信和平	357,460	4,707,748.20	0.06
535	600353	旭光股份	561,055	4,690,419.80	0.06
536	600863	内蒙华电	1,026,852	4,682,445.12	0.06
537	600352	浙江龙盛	237,846	4,680,809.28	0.06
538	000831	五矿稀土	155,665	4,668,393.35	0.06
539	300245	天玑科技	266,982	4,666,845.36	0.06
540	000078	海王生物	477,102	4,661,286.54	0.06
541	000636	风华高科	526,023	4,660,563.78	0.06
542	600816	安信信托	158,541	4,657,934.58	0.06
543	600592	龙溪股份	452,731	4,654,074.68	0.06
544	600807	天业股份	523,385	4,652,892.65	0.06
545	600328	兰太实业	518,101	4,637,003.95	0.06
546	002203	海亮股份	525,187	4,626,897.47	0.06
547	600117	西宁特钢	908,312	4,623,308.08	0.06
548	300049	福瑞股份	142,090	4,617,925.00	0.06
549	000402	金融街	374,318	4,615,340.94	0.06
550	600970	中材国际	342,983	4,599,402.03	0.06
551	000716	黑芝麻	352,359	4,570,096.23	0.06
552	002260	伊立浦	217,456	4,566,576.00	0.06
553	000069	华侨城A	552,485	4,558,001.25	0.06
554	000703	恒逸石化	503,683	4,548,257.49	0.06
555	600191	华资实业	512,777	4,538,076.45	0.06
556	300127	银河磁体	388,187	4,537,906.03	0.06
557	300104	乐视网	139,809	4,535,403.96	0.06
558	300056	三维丝	205,137	4,508,911.26	0.06
559	600125	铁龙物流	505,882	4,482,114.52	0.06
560	000159	国际实业	440,431	4,479,183.27	0.06
561	601113	华鼎股份	764,341	4,479,038.26	0.06
562	002137	实益达	640,810	4,466,445.70	0.06
563	600590	泰豪科技	500,472	4,464,210.24	0.06
564	300234	开尔新材	318,972	4,462,418.28	0.05
565	002501	利源精制	159,650	4,457,428.00	0.05
566	600158	中体产业	250,740	4,440,605.40	0.05
567	601607	上海医药	268,635	4,432,477.50	0.05
568	002179	中航光电	188,699	4,430,652.52	0.05
569	300160	秀强股份	269,901	4,412,881.35	0.05

570	300095	华伍股份	445,054	4,388,232.44	0.05
571	601003	柳钢股份	1,110,303	4,385,696.85	0.05
572	600390	金瑞科技	376,251	4,379,561.64	0.05
573	000708	大冶特钢	443,394	4,376,298.78	0.05
574	600820	隧道股份	529,608	4,374,562.08	0.05
575	300044	赛为智能	332,170	4,368,035.50	0.05
576	002500	山西证券	272,499	4,359,984.00	0.05
577	601107	四川成渝	804,226	4,358,904.92	0.05
578	002590	万安科技	360,305	4,356,087.45	0.05
579	002385	大北农	324,315	4,352,307.30	0.05
580	600508	上海能源	385,398	4,339,581.48	0.05
581	600311	荣华实业	683,241	4,324,915.53	0.05
582	600486	扬农化工	143,670	4,324,467.00	0.05
583	000848	承德露露	195,903	4,307,906.97	0.05
584	002267	陕天然气	398,430	4,307,028.30	0.05
585	002133	广宇集团	875,330	4,271,610.40	0.05
586	600362	江西铜业	231,109	4,261,649.96	0.05
587	000959	首钢股份	1,023,230	4,246,404.50	0.05
588	600605	汇通能源	348,944	4,239,669.60	0.05
589	600215	长春经开	758,402	4,239,467.18	0.05
590	002305	南国置业	586,942	4,231,851.82	0.05
591	600883	博闻科技	456,966	4,226,935.50	0.05
592	000973	佛塑科技	682,809	4,219,759.62	0.05
593	600844	丹化科技	554,810	4,216,556.00	0.05
594	002540	亚太科技	236,734	4,209,130.52	0.05
595	600507	方大特钢	792,877	4,202,248.10	0.05
596	000531	穗恒运 A	313,265	4,197,751.00	0.05
597	000690	宝新能源	661,535	4,180,901.20	0.05
598	601369	陕鼓动力	480,150	4,177,305.00	0.05
599	002323	中联电气	190,101	4,172,716.95	0.05
600	600759	洲际油气	420,531	4,163,256.90	0.05
601	600383	金地集团	364,740	4,161,683.40	0.05
602	002041	登海种业	129,802	4,160,154.10	0.05
603	002042	华孚色纺	770,096	4,135,415.52	0.05
604	300157	恒泰艾普	407,667	4,113,360.03	0.05
605	000667	美好集团	1,295,703	4,107,378.51	0.05
606	600618	氯碱化工	412,242	4,101,807.90	0.05
607	000584	友利控股	596,300	4,084,655.00	0.05
608	002146	荣盛发展	256,895	4,076,923.65	0.05
609	300323	华灿光电	446,996	4,076,603.52	0.05
610	600067	冠城大通	501,892	4,065,325.20	0.05
611	600393	东华实业	573,334	4,064,938.06	0.05
612	600660	福耀玻璃	332,291	4,034,012.74	0.05
613	002244	滨江集团	501,277	4,030,267.08	0.05

614	000761	本钢板材	777,547	4,012,142.52	0.05
615	000426	兴业矿业	335,300	4,006,835.00	0.05
616	000688	建新矿业	551,629	3,988,277.67	0.05
617	600653	中华控股	1,090,015	3,967,654.60	0.05
618	002384	东山精密	361,935	3,959,568.90	0.05
619	600578	京能电力	625,224	3,951,415.68	0.05
620	002204	大连重工	329,016	3,944,901.84	0.05
621	002673	西部证券	104,886	3,927,980.70	0.05
622	600143	金发科技	569,727	3,925,419.03	0.05
623	600835	上海机电	208,619	3,913,692.44	0.05
624	600011	华能国际	442,738	3,909,376.54	0.05
625	002491	通鼎光电	190,427	3,903,753.50	0.05
626	300077	国民技术	145,649	3,885,915.32	0.05
627	600323	瀚蓝环境	268,061	3,878,842.67	0.05
628	002480	新筑股份	342,651	3,871,956.30	0.05
629	000930	中粮生化	487,332	3,869,416.08	0.05
630	600129	太极集团	227,501	3,862,966.98	0.05
631	600729	重庆百货	154,134	3,851,808.66	0.05
632	600595	中孚实业	659,539	3,851,707.76	0.05
633	600612	老凤祥	119,114	3,850,955.62	0.05
634	600210	紫江企业	761,147	3,843,792.35	0.05
635	000825	太钢不锈	728,415	3,838,747.05	0.05
636	601588	北辰实业	800,974	3,836,665.46	0.05
637	002440	闰土股份	213,354	3,823,303.68	0.05
638	002310	东方园林	206,983	3,822,976.01	0.05
639	600269	赣粤高速	755,382	3,814,679.10	0.05
640	002534	杭锅股份	208,441	3,812,385.89	0.05
641	600309	万华化学	174,652	3,803,920.56	0.05
642	000936	华西股份	621,800	3,799,198.00	0.05
643	600418	江淮汽车	314,000	3,793,120.00	0.05
644	300054	鼎龙股份	288,212	3,787,105.68	0.05
645	600881	亚泰集团	505,910	3,779,147.70	0.05
646	002375	亚厦股份	198,893	3,771,011.28	0.05
647	000042	中洲控股	245,460	3,762,901.80	0.05
648	600120	浙江东方	200,947	3,761,727.84	0.05
649	000543	皖能电力	290,020	3,723,856.80	0.05
650	600983	惠而浦	302,260	3,717,798.00	0.05
651	600187	国中水务	484,628	3,717,096.76	0.05
652	601566	九牧王	286,959	3,701,771.10	0.05
653	002249	大洋电机	322,857	3,699,941.22	0.05
654	300143	星河生物	289,524	3,694,326.24	0.05
655	600438	通威股份	395,493	3,678,084.90	0.05
656	601888	中国国旅	82,604	3,667,617.60	0.05
657	300020	银江股份	132,582	3,655,285.74	0.05

658	600736	苏州高新	633,318	3,654,244.86	0.05
659	600100	同方股份	312,731	3,652,698.08	0.05
660	002064	华峰氨纶	341,369	3,652,648.30	0.05
661	600723	首商股份	454,816	3,647,624.32	0.04
662	600063	皖维高新	775,900	3,646,730.00	0.04
663	002001	新和成	239,783	3,637,508.11	0.04
664	000793	华闻传媒	321,620	3,634,306.00	0.04
665	002368	太极股份	82,438	3,619,028.20	0.04
666	600596	新安股份	348,340	3,615,769.20	0.04
667	600380	健康元	502,801	3,615,139.19	0.04
668	601801	皖新传媒	217,357	3,612,473.34	0.04
669	601766	中国南车	565,200	3,605,976.00	0.04
670	600150	中国船舶	97,771	3,603,839.06	0.04
671	002327	富安娜	267,727	3,587,541.80	0.04
672	600375	华菱星马	294,574	3,584,965.58	0.04
673	002276	万马股份	435,073	3,580,650.79	0.04
674	000800	一汽轿车	236,105	3,574,629.70	0.04
675	600642	申能股份	552,562	3,569,550.52	0.04
676	300105	龙源技术	285,227	3,568,189.77	0.04
677	000415	渤海租赁	260,985	3,567,664.95	0.04
678	600805	悦达投资	315,528	3,565,466.40	0.04
679	600619	海立股份	384,600	3,553,704.00	0.04
680	601058	赛轮金宇	223,071	3,551,290.32	0.04
681	600416	湘电股份	294,479	3,545,527.16	0.04
682	000598	兴蓉投资	462,843	3,536,120.52	0.04
683	601222	林洋电子	156,170	3,535,688.80	0.04
684	002433	太安堂	306,630	3,532,377.60	0.04
685	000887	中鼎股份	255,467	3,525,444.60	0.04
686	000539	粤电力A	448,775	3,518,396.00	0.04
687	002393	力生制药	109,833	3,517,950.99	0.04
688	600329	中新药业	229,783	3,506,488.58	0.04
689	002251	步步高	250,034	3,502,976.34	0.04
690	002447	壹桥苗业	238,282	3,502,745.40	0.04
691	600481	双良节能	346,092	3,492,068.28	0.04
692	000858	五粮液	162,389	3,491,363.50	0.04
693	000338	潍柴动力	127,714	3,485,315.06	0.04
694	002320	海峡股份	321,814	3,485,245.62	0.04
695	600062	华润双鹤	171,905	3,482,795.30	0.04
696	002230	科大讯飞	130,665	3,482,222.25	0.04
697	600509	天富能源	352,597	3,480,132.39	0.04
698	600425	青松建化	504,048	3,472,890.72	0.04
699	002029	七匹狼	389,454	3,470,035.14	0.04
700	600089	特变电工	280,034	3,466,820.92	0.04
701	600073	上海梅林	369,328	3,464,296.64	0.04

702	600168	武汉控股	255,800	3,458,416.00	0.04
703	002309	中利科技	183,619	3,457,545.77	0.04
704	600220	江苏阳光	884,252	3,448,582.80	0.04
705	601567	三星电气	184,020	3,448,534.80	0.04
706	600548	深高速	415,663	3,445,846.27	0.04
707	600626	申达股份	431,985	3,442,920.45	0.04
708	300128	锦富新材	269,656	3,438,114.00	0.04
709	000600	建投能源	338,309	3,433,836.35	0.04
710	000897	津滨发展	454,720	3,433,136.00	0.04
711	600567	山鹰纸业	1,187,109	3,430,745.01	0.04
712	600280	中央商场	236,471	3,405,182.40	0.04
713	600389	江山股份	127,577	3,390,996.66	0.04
714	600348	阳泉煤业	381,879	3,387,266.73	0.04
715	000933	神火股份	564,999	3,384,344.01	0.04
716	300039	上海凯宝	265,947	3,372,207.96	0.04
717	002138	顺络电子	192,538	3,359,788.10	0.04
718	601700	风范股份	244,613	3,351,198.10	0.04
719	600987	航民股份	391,639	3,348,513.45	0.04
720	002085	万丰奥威	126,333	3,347,824.50	0.04
721	600683	京投银泰	440,365	3,342,370.35	0.04
722	000786	北新建材	131,528	3,325,027.84	0.04
723	002481	双塔食品	190,094	3,324,744.06	0.04
724	600664	哈药股份	382,304	3,318,398.72	0.04
725	000861	海印股份	412,619	3,313,330.57	0.04
726	600429	三元股份	373,968	3,302,137.44	0.04
727	000601	韶能股份	557,815	3,285,530.35	0.04
728	600166	福田汽车	523,315	3,275,951.90	0.04
729	600059	古越龙山	366,072	3,272,683.68	0.04
730	600110	中科英华	517,745	3,266,970.95	0.04
731	601999	出版传媒	311,210	3,264,592.90	0.04
732	600322	天房发展	694,256	3,263,003.20	0.04
733	000503	海虹控股	104,124	3,256,998.72	0.04
734	300034	钢研高纳	151,264	3,255,201.28	0.04
735	000652	泰达股份	445,103	3,249,251.90	0.04
736	600077	宋都股份	569,316	3,233,714.88	0.04
737	002065	东华软件	180,000	3,223,800.00	0.04
738	600037	歌华有线	222,420	3,222,865.80	0.04
739	000012	南玻 A	362,343	3,221,229.27	0.04
740	300059	东方财富	114,892	3,212,380.32	0.04
741	300050	世纪鼎利	211,748	3,210,099.68	0.04
742	600184	光电股份	89,208	3,197,214.72	0.04
743	600033	福建高速	837,889	3,192,357.09	0.04
744	300002	神州泰岳	192,275	3,191,765.00	0.04
745	300012	华测检测	212,880	3,182,556.00	0.04

746	600499	科达洁能	172,100	3,176,966.00	0.04
747	600132	重庆啤酒	196,169	3,174,014.42	0.04
748	000089	深圳机场	546,431	3,169,299.80	0.04
749	000750	国海证券	181,423	3,154,945.97	0.04
750	600797	浙大网新	430,130	3,131,346.40	0.04
751	600157	永泰能源	717,021	3,126,211.56	0.04
752	002532	新界泵业	302,890	3,119,767.00	0.04
753	300238	冠昊生物	66,647	3,117,080.19	0.04
754	002358	森源电气	88,940	3,112,900.00	0.04
755	600277	亿利能源	348,485	3,108,486.20	0.04
756	600658	电子城	264,016	3,094,267.52	0.04
757	601218	吉鑫科技	451,921	3,082,101.22	0.04
758	600676	交运股份	371,418	3,079,055.22	0.04
759	002281	光迅科技	82,419	3,062,690.04	0.04
760	600035	楚天高速	676,671	3,051,786.21	0.04
761	002104	恒宝股份	251,960	3,048,716.00	0.04
762	001696	宗申动力	382,521	3,048,692.37	0.04
763	300274	阳光电源	188,149	3,040,487.84	0.04
764	000563	陕国投 A	241,666	3,037,741.62	0.04
765	000630	铜陵有色	195,902	3,032,562.96	0.04
766	002050	三花股份	223,300	3,030,181.00	0.04
767	000669	金鸿能源	102,884	3,019,645.40	0.04
768	002273	水晶光电	176,487	3,017,927.70	0.04
769	000099	中信海直	219,393	3,016,653.75	0.04
770	600895	张江高科	226,213	3,013,157.16	0.04
771	002016	世荣兆业	342,602	2,997,767.50	0.04
772	002073	软控股份	247,085	2,992,199.35	0.04
773	600530	交大昂立	249,274	2,986,302.52	0.04
774	600330	天通股份	319,900	2,968,672.00	0.04
775	600373	中文传媒	222,628	2,965,404.96	0.04
776	002185	华天科技	236,533	2,954,297.17	0.04
777	000559	万向钱潮	246,006	2,920,091.22	0.04
778	601777	力帆股份	329,309	2,917,677.74	0.04
779	002277	友阿股份	230,985	2,917,340.55	0.04
780	600251	冠农股份	159,753	2,917,089.78	0.04
781	600846	同济科技	335,285	2,900,215.25	0.04
782	600088	中视传媒	163,906	2,899,497.14	0.04
783	600601	方正科技	619,310	2,898,370.80	0.04
784	002004	华邦颖泰	166,574	2,895,056.12	0.04
785	601669	中国电建	343,008	2,891,557.44	0.04
786	600023	浙能电力	403,247	2,891,280.99	0.04
787	000829	天音控股	359,701	2,888,399.03	0.04
788	002456	欧菲光	152,247	2,886,603.12	0.04
789	600333	长春燃气	373,081	2,868,992.89	0.04

790	600897	厦门空港	117,537	2,819,712.63	0.03
791	002226	江南化工	222,825	2,803,138.50	0.03
792	002340	格林美	216,590	2,798,342.80	0.03
793	300088	长信科技	180,304	2,789,302.88	0.03
794	600815	厦工股份	313,259	2,788,005.10	0.03
795	600133	东湖高新	332,808	2,778,946.80	0.03
796	002155	辰州矿业	271,046	2,761,958.74	0.03
797	002122	天马股份	361,595	2,758,969.85	0.03
798	002353	杰瑞股份	90,143	2,755,671.51	0.03
799	000049	德赛电池	91,315	2,750,407.80	0.03
800	600498	烽火通信	176,146	2,716,171.32	0.03
801	002342	巨力索具	442,740	2,700,714.00	0.03
802	002049	同方国芯	111,970	2,687,280.00	0.03
803	000883	湖北能源	414,000	2,662,020.00	0.03
804	002573	国电清新	95,634	2,647,149.12	0.03
805	601872	招商轮船	420,500	2,644,945.00	0.03
806	002356	浩宁达	68,383	2,610,862.94	0.03
807	600467	好当家	409,860	2,606,709.60	0.03
808	000888	峨眉山 A	135,049	2,595,641.78	0.03
809	600874	创业环保	229,632	2,537,433.60	0.03
810	000712	锦龙股份	92,338	2,511,593.60	0.03
811	600804	鹏博士	139,429	2,506,933.42	0.03
812	002216	三全食品	126,741	2,460,042.81	0.03
813	000966	长源电力	191,561	2,425,162.26	0.03
814	002032	苏泊尔	141,690	2,411,563.80	0.03
815	600649	城投控股	330,600	2,390,238.00	0.03
816	600439	瑞贝卡	494,812	2,365,201.36	0.03
817	000151	中成股份	122,766	2,323,960.38	0.03
818	300006	莱美药业	77,757	2,322,601.59	0.03
819	601299	中国北车	327,100	2,322,410.00	0.03
820	600490	鹏欣资源	214,657	2,316,149.03	0.03
821	002129	中环股份	109,893	2,313,247.65	0.03
822	002223	鱼跃医疗	92,420	2,306,803.20	0.03
823	000937	冀中能源	275,895	2,300,964.30	0.03
824	002574	明牌珠宝	223,271	2,286,295.04	0.03
825	600406	国电南瑞	153,055	2,226,950.25	0.03
826	600628	新世界	209,639	2,192,823.94	0.03
827	600139	西部资源	179,358	2,182,786.86	0.03
828	600200	江苏吴中	179,814	2,155,969.86	0.03
829	002225	濮耐股份	308,346	2,130,670.86	0.03
830	600587	新华医疗	67,766	2,123,108.78	0.03
831	600812	华北制药	340,467	2,107,490.73	0.03
832	600754	锦江股份	82,699	2,076,571.89	0.03
833	601002	晋亿实业	105,818	2,053,927.38	0.03

834	600740	山西焦化	303,609	2,040,252.48	0.03
835	000401	冀东水泥	155,699	2,034,985.93	0.03
836	600755	厦门国贸	176,403	1,993,353.90	0.02
837	600826	兰生股份	100,930	1,977,218.70	0.02
838	002161	远望谷	242,081	1,960,856.10	0.02
839	600810	神马股份	270,634	1,951,271.14	0.02
840	600229	青岛碱业	222,576	1,918,605.12	0.02
841	600081	东风科技	138,990	1,887,484.20	0.02
842	000762	西藏矿业	139,498	1,867,878.22	0.02
843	603366	日出东方	114,985	1,866,206.55	0.02
844	300181	佐力药业	144,209	1,841,548.93	0.02
845	601168	西部矿业	193,697	1,789,760.28	0.02
846	300336	新文化	66,976	1,774,864.00	0.02
847	000028	国药一致	36,799	1,756,416.27	0.02
848	600594	益佰制药	51,983	1,734,672.71	0.02
849	600765	中航重机	87,864	1,673,809.20	0.02
850	600420	现代制药	77,142	1,613,039.22	0.02
851	002657	中科金财	32,000	1,519,680.00	0.02
852	300342	天银机电	93,594	1,513,414.98	0.02
853	600078	澄星股份	201,628	1,377,119.24	0.02
854	000615	湖北金环	115,301	1,124,184.75	0.01
855	000558	莱茵置业	169,938	1,014,529.86	0.01
856	300198	纳川股份	143,250	1,002,750.00	0.01
857	000513	丽珠集团	18,907	934,762.08	0.01
858	600105	永鼎股份	86,621	854,083.06	0.01
859	000616	亿城投资	171,600	818,532.00	0.01
860	002558	世纪游轮	24,213	766,341.45	0.01
861	300295	三六五网	8,950	678,410.00	0.01
862	002184	海得控制	26,768	584,077.76	0.01
863	600396	金山股份	49,400	331,474.00	0.00
864	601519	大智慧	40,500	242,190.00	0.00
865	002171	精诚铜业	11,518	150,540.26	0.00
866	002736	国信证券	7,500	76,200.00	0.00
867	300405	科隆精化	500	22,220.00	0.00
868	002733	雄韬股份	500	14,540.00	0.00
869	601015	陕西黑猫	1,000	14,260.00	0.00
870	002732	燕塘乳业	500	11,840.00	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	600690	青岛海尔	449,154,985.30	4.95
2	601318	中国平安	413,957,785.29	4.56
3	000002	万 科 A	345,772,282.55	3.81
4	601877	正泰电器	296,487,881.36	3.27
5	600588	用友网络	276,159,654.45	3.04
6	600649	城投控股	274,054,837.52	3.02
7	600309	万华化学	264,881,491.82	2.92
8	600519	贵州茅台	264,054,891.88	2.91
9	600887	伊利股份	242,129,018.94	2.67
10	600019	宝钢股份	241,949,383.66	2.67
11	000895	双汇发展	235,159,576.54	2.59
12	600079	人福医药	221,449,778.22	2.44
13	600406	国电南瑞	209,988,810.25	2.31
14	002311	海大集团	201,352,496.74	2.22
15	600795	国电电力	179,852,099.10	1.98
16	000999	华润三九	169,303,804.34	1.87
17	000963	华东医药	165,764,691.45	1.83
18	600585	海螺水泥	164,374,741.04	1.81
19	002028	思源电气	162,570,362.71	1.79
20	600521	华海药业	159,092,732.36	1.75

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	600886	国投电力	493,622,628.94	5.44
2	601166	兴业银行	432,390,814.39	4.77
3	000002	万 科 A	415,125,779.37	4.58
4	601601	中国太保	413,637,640.16	4.56
5	600690	青岛海尔	397,213,972.20	4.38
6	601318	中国平安	383,833,792.06	4.23
7	600588	用友网络	365,622,916.92	4.03
8	600519	贵州茅台	329,183,719.35	3.63
9	600000	浦发银行	322,557,677.05	3.56
10	600221	海南航空	305,261,859.63	3.36
11	601877	正泰电器	295,628,883.86	3.26
12	600019	宝钢股份	265,143,344.91	2.92

13	600649	城投控股	263,009,636.13	2.90
14	600079	人福医药	253,345,235.78	2.79
15	600406	国电南瑞	242,483,950.31	2.67
16	600009	上海机场	237,144,773.05	2.61
17	600309	万华化学	235,277,974.84	2.59
18	600585	海螺水泥	228,129,929.72	2.51
19	000063	中兴通讯	227,608,856.29	2.51
20	000001	平安银行	220,688,097.36	2.43
21	002311	海大集团	214,421,629.61	2.36
22	600741	华域汽车	213,217,701.66	2.35
23	000895	双汇发展	212,825,174.76	2.35
24	000963	华东医药	206,828,628.69	2.28
25	600104	上汽集团	204,470,235.88	2.25
26	600256	广汇能源	200,925,713.45	2.21
27	600887	伊利股份	194,921,800.20	2.15

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	23,611,595,074.94
卖出股票的收入（成交）总额	25,903,694,099.03

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

本基金本报告期末未投资贵金属。

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	2,093,598.27
2	应收证券清算款	1,024,734.75
3	应收股利	-
4	应收利息	154,109.81
5	应收申购款	191,181.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,463,624.82

8.12.3 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。

8.12.4 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
449,142	17,427.56	349,299,981.73	4.46%	7,478,150,546.20	95.54%

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	170,426.51	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	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(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	10,229,878,724.51
本报告期基金总申购份额	444,675,845.52
减：本报告期基金总赎回份额	2,847,104,042.10
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	7,827,450,527.93
-------------	------------------

§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

陶耿先生自 2014 年 3 月 13 日起担任本基金管理人总经理。自陶耿先生任总经理职务之日起，本基金管理人董事长林昌先生不再代行总经理职务。2014 年 8 月 22 日，盛松先生离任本基金管理人督察长，转任副总经理兼首席投资总监；本基金管理人督察长一职由总经理陶耿先生代任。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。

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 10 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	
平安证券	1	485,067,677.92	0.98%	429,237.54	0.96%	-

中信建投	1	570,135,428.15	1.15%	519,050.08	1.17%	-
齐鲁证券	1	746,924,268.05	1.51%	679,996.04	1.53%	-
国泰君安	2	904,993,317.35	1.83%	823,905.70	1.85%	-
安信证券	1	912,211,965.49	1.84%	830,475.53	1.87%	-
申银万国	2	981,694,884.59	1.98%	893,737.04	2.01%	-
中银国际	1	1,086,315,760.52	2.19%	988,980.14	2.22%	-
中投建银	1	1,170,903,249.63	2.36%	1,036,134.50	2.33%	-
中金公司	1	1,451,151,766.88	2.93%	1,321,129.72	2.97%	-
广发证券	1	1,619,603,504.58	3.27%	1,433,191.78	3.22%	-
银河证券	1	1,625,538,167.76	3.28%	1,479,886.61	3.33%	-
长江证券	1	1,755,334,656.71	3.55%	1,598,056.55	3.59%	-
宏源证券	1	1,969,243,868.30	3.98%	1,742,586.83	3.92%	-
高华证券	1	2,386,992,548.91	4.82%	2,173,114.06	4.88%	-
兴业证券	1	3,513,094,152.88	7.10%	3,198,305.06	7.19%	-
国信证券	1	4,770,973,159.43	9.64%	4,221,840.02	9.49%	-
东方证券	1	5,594,455,663.04	11.30%	5,093,182.30	11.45%	-
光大证券	2	17,968,240,900.42	36.29%	16,032,363.15	36.03%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）新增租用交易单元

本报告期内本基金无新增租用交易单元。

（2）停止租用：本基金报告期内停止租用1个交易单元：银河证券（296400）。

（3）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	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》	2014-12-31
2	关于旗下部分基金新增上海联泰资产管理有限公司为代销机构并同时开通基金定期定额投资及基金转换业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-12-27
3	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》	2014-12-24
4	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》	2014-12-23
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》	2014-11-25
6	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年第 3 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-10-27
7	关于旗下部分基金新增深圳市新兰德证券投资咨询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》	2014-10-22
8	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》	2014-10-09
9	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》	2014-10-09
10	关于旗下部分基金新增北京钱景财富投资管理有限公司为代销机构并参与其交易费率优	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-09-12

	惠活动的公告		
11	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年半年度报告（摘要）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-08-29
12	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年半年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-08-29
13	光大保德信基金管理有限公司关于网上直销平台(含移动终端)开通上海富友支付服务有限公司基金支付业务并实施交易费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-08-15
14	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-08-02
15	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年第 2 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-07-18
16	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金新增一路财富（北京）信息科技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》	2014-07-07
17	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华夏银行股份有限公司手机银行交易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》	2014-07-01
18	光大保德信基金管理有限公司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》	2014-06-30
19	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》	2014-06-17
20	关于参加上海天天基金销售有限公司周三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》	2014-04-30
21	光大保德信基金管理有限公司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（四维图新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-04-29
22	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（四维图新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-04-29
23	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（四维图新）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-04-29
24	光大保德信量化核心证券投资基金 2014 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-04-21
25	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》	2014-04-11
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》	2014-04-11
27	光大保德信量化核心证券投资基金 2013 年年度报告（正文）	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-03-31
28	光大保德信量化核心证券投资基金 2013 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-03-31

29	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》	2014-03-29
30	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》	2014-03-28
31	关于旗下部分基金变更业绩比较基准的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-03-27
32	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-02-25
33	光大保德信量化核心证券投资基金 2013 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-22
34	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-09
35	关于旗下部分基金参与中国工商银行基金定期定额投资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》	2014-01-03

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，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

二〇一五年三月三十日