

光大保德信量化核心证券投资基金
2015 年半年度报告
2015 年 6 月 30 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：二〇一五年八月二十八日

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。本半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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
7.6 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.....	55
7.7 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.....	55
7.8 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.....	55
7.9 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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	56
8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3	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	57
9	开放式基金份额变动	57
10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
10.2	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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	58
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8	其他重大事件	60
11	影响投资者决策的其他重要信息	61
12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

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	2,960,393,809.07 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		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中国光大中心
办公地址		上海市延安东路222号外滩中	北京市西城区太平桥大街25号

	心46楼	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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,997,522,415.57
本期利润	3,899,549,617.75
加权平均基金份额本期利润	0.6674
本期加权平均净值利润率	51.05%
本期基金份额净值增长率	56.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,535,695,942.99
期末可供分配基金份额利润	0.8565
期末基金资产净值	4,748,652,787.22
期末基金份额净值	1.6041
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	475.77%

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

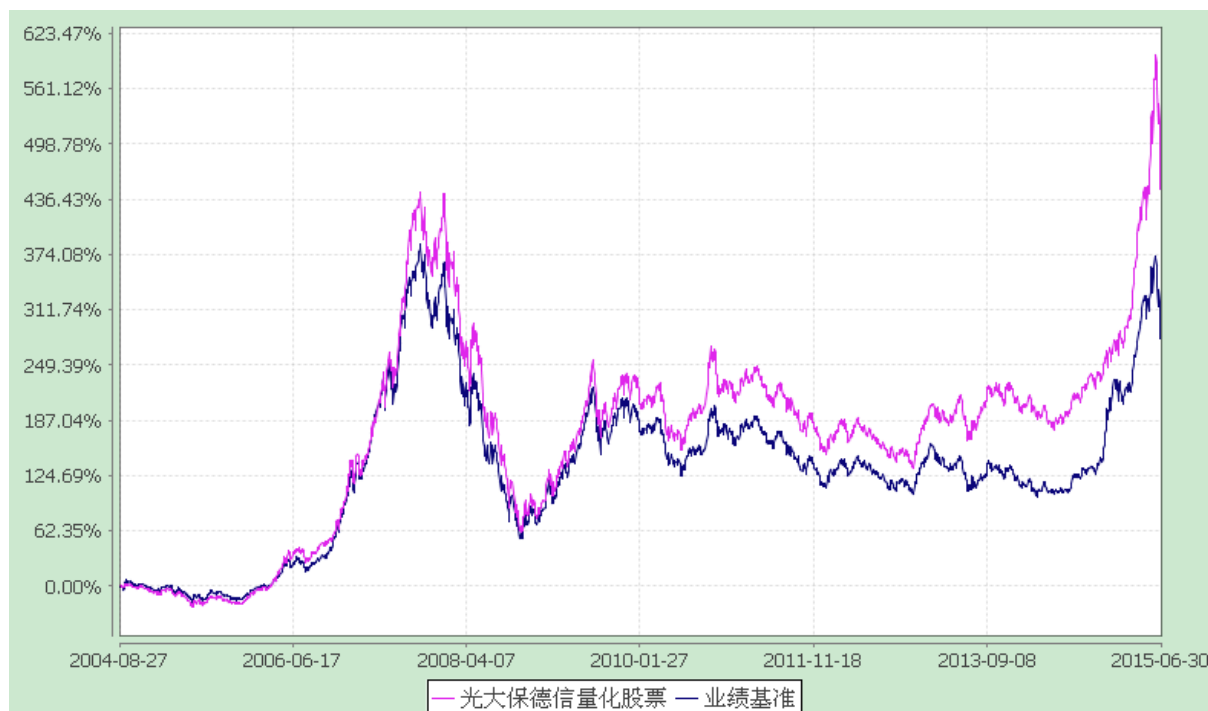
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-4.78%	3.38%	-6.75%	3.15%	1.97%	0.23%
过去三个月	22.37%	2.56%	9.55%	2.35%	12.82%	0.21%
过去六个月	56.87%	2.04%	24.02%	2.03%	32.85%	0.01%
过去一年	96.94%	1.61%	93.01%	1.65%	3.93%	-0.04%
过去三年	113.96%	1.37%	74.71%	1.34%	39.25%	0.03%
自基金合同生效起至今	475.77%	1.70%	301.98%	1.60%	173.79%	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”。

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历史走势对比图
 （2004 年 8 月 27 日至 2015 年 6 月 30 日）



注：1、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”。

2、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。

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 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 20 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

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、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和光大保德信一带一路战略主题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	-	4 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：1、“任职日期”和“离任日期”分别为公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 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。本基金与其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

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 年上半年，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 月份出现快速下跌，银行等权重板块抗跌能力凸显。在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。

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 56.87%，业绩比较基准收益率为 24.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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的末期。在这个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，特别是一些杠杆资金、做空工具的加入，这种震荡会被激烈放大。但作为专业投资者，我们还是要认清市场发展的本质，市场发展的大趋势。如果经过亦步亦趋的分析研究，我们认为第一阶段的改革预期和流动性的宽裕仍然存在，如果我们进一步判断第二阶段的衔接不会出现大时段的间隔，那么目前短期市场的下跌反而提供了非常好的建仓良机。从目前我们的研究判断来看，我

们对之后的市场是乐观的。

我们认识到，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，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，为基金份额持有人服务。

4.6 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。

4.7 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，本基金本报告期内进行利润分配,分配方案为每份 0.02 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内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

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

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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 年半年度报告”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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	455,648,414.21	634,001,672.57
结算备付金		33,604,804.00	32,528,294.49
存出保证金		4,379,606.31	2,093,598.27
交易性金融资产	6.4.7.2	4,441,945,827.00	7,508,779,565.78
其中：股票投资		4,441,945,827.00	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,024,734.75
应收利息	6.4.7.5	100,490.82	154,109.81
应收股利		-	-
应收申购款		5,524,361.27	191,181.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,941,203,503.61	8,178,773,157.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		166,101,925.09	30,450,373.38
应付管理人报酬		7,373,316.53	10,468,287.30
应付托管费		1,228,886.09	1,744,714.56
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	17,567,856.01	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	6.4.7.8	278,732.67	402,697.87
负债合计		192,550,716.39	62,120,750.29
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,083,322,610.49	2,832,275,090.22
未分配利润		3,665,330,176.73	5,284,377,317.15
所有者权益合计		4,748,652,787.22	8,116,652,407.37
负债和所有者权益总计		4,941,203,503.61	8,178,773,157.66

注：报告截止日 2015 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6041 元，基金份额总额 2,960,393,809.07 份。

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		4,022,920,180.11	-511,251,923.02
1.利息收入		2,554,246.27	2,535,727.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,554,246.27	2,535,727.47
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）		4,117,630,611.30	-339,136,936.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,091,750,234.62	-463,439,217.73
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	25,880,376.68	124,302,281.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-97,972,797.82	-175,117,369.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	708,120.36	466,655.44

减：二、费用		123,370,562.36	90,883,838.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2	56,820,966.29	59,799,810.52
2. 托管费	6.4.10.2	9,470,161.06	9,966,635.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	56,881,080.73	20,919,038.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.22	198,354.28	198,354.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,899,549,617.75	-602,135,761.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,899,549,617.75	-602,135,761.07

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	-	3,899,549,617.75	3,899,549,617.75
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）	-1,748,952,479.73	-5,404,672,061.61	-7,153,624,541.34
其中：1.基金申购款	100,514,653.50	223,063,717.67	323,578,371.17
2.基金赎回款	-1,849,467,133.23	-5,627,735,779.28	-7,477,202,912.51
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）	1,083,322,610.49	3,665,330,176.73	4,748,652,787.22
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	-	-602,135,761.07	-602,135,761.07

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-379,617,652.87	-508,828,070.09	-888,445,722.96
其中：1.基金申购款	19,079,109.15	25,032,044.16	44,111,153.31
2.基金赎回款	-398,696,762.02	-533,860,114.25	-932,556,876.27
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）	3,321,939,746.30	4,260,343,402.61	7,582,283,148.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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，由光大保德信基金管理有限公司作为基金管理人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。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除本基金本报告期所采用的会计估计有变更外，其他重要会计政策与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	455,648,414.21
定期存款	-
其他存款	-
合计	455,648,414.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,980,884,784.67	4,441,945,827.00	461,061,042.33
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	3,980,884,784.67	4,441,945,827.00	461,061,042.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	85,059.96
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	13,609.98
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	47.16
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,773.72
合计	100,490.82

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	17,567,856.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	17,567,856.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	64,978.39
其他	15,400.00
预提费用	198,354.28
合计	278,732.67

6.4.7.9 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 6 月 30 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	214,655,660.81	100,514,653.50
本期赎回（以“-”号填列）	-5,081,712,379.67	-1,849,467,133.23
本期末	2,960,393,809.07	1,083,322,610.49

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	3,997,522,415.57	-97,972,797.82	3,899,549,617.75
本期基金份额交易产生的变动数	-2,079,353,241.06	-3,325,318,820.55	-5,404,672,061.61
其中：基金申购款	74,719,587.58	148,344,130.09	223,063,717.67
基金赎回款	-2,154,072,828.64	-3,473,662,950.64	-5,627,735,779.28
本期已分配利润	-113,924,696.56	-	-113,924,696.56
本期末	2,535,695,942.99	1,129,634,233.74	3,665,330,176.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,305,581.84
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	225,162.01
其他	23,502.42
合计	2,554,246.27

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,187,415,691.07
减：卖出股票成本总额	17,095,665,456.45
买卖股票差价收入	4,091,750,234.62

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,880,376.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,880,376.68

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-97,972,797.82
——股票投资	-97,972,797.82
——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	-97,972,797.82

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
基金赎回费收入	694,734.65
转换费收入	13,385.71
合计	708,120.36

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期

	2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	56,881,080.73
银行间市场交易费用	-
合计	56,881,080.73

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
合计	198,354.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	11,273,955,858.38	31.94%	4,307,764,029.94	32.04%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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6月30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	10,053,404.19	31.76%	4,326,639.39	24.63%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	3,847,063.89	31.75%	303,470.64	15.89%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,820,966.29	59,799,810.52
其中：支付销售机构的客户维护费	11,715,898.65	12,204,419.43

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月 30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,470,161.06	9,966,635.13

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。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方于本期期末和上年度可比期末均未投资本基金。

6.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	455,648,414.21	2,305,581.84	692,249,757.21	2,431,737.22

6.4.10.6 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。

6.4.11 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					
1	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	-

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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
000429	粤高速 A	2015-04-08	重大事项	6.42	2015-07-22	7.06	658,383.00	3,169,485.59	4,226,818.86	-
000519	江南红箭	2015-06-15	重大事项	26.06	-	-	113,700.00	2,272,681.18	2,963,022.00	-
000543	皖能电力	2015-06-15	重大事项	21.36	2015-07-14	19.04	731,438.00	13,262,064.91	15,623,515.68	-
000608	阳光股份	2015-05-25	重大事项	8.23	2015-08-21	7.41	392,902.00	1,882,449.14	3,233,583.46	-
000650	仁和药业	2015-06-12	重大事项	17.17	-	-	308,454.00	2,044,419.00	5,296,155.18	-
000669	金鸿能源	2015-05-04	重大事项	37.72	2015-07-23	33.95	166,702.00	5,734,695.27	6,287,999.44	-
000672	上峰水泥	2015-06-03	重大事项	12.05	-	-	252,000.00	2,354,927.89	3,036,600.00	-
000693	华泽钴镍	2015-06-30	重大事项	20.57	2015-08-18	32.50	63,000.00	1,543,330.95	1,295,910.00	-

000709	河北钢铁	2015-06-30	重大事项	7.00	2015-08-24	6.30	167,100.00	826,597.66	1,169,700.00	-
000716	黑芝麻	2015-06-08	重大事项	23.69	2015-08-03	21.32	444,014.00	10,146,324.19	10,518,691.66	-
000732	泰禾集团	2015-06-25	重大事项	34.20	2015-07-02	30.58	206,634.00	6,498,910.38	7,066,882.80	-
000778	新兴铸管	2015-06-15	重大事项	12.96	-	-	-3,124,780.00	22,496,041.27	40,497,148.80	-
000786	北新建材	2015-04-10	重大事项	18.58	-	-	738,400.00	9,585,191.13	13,719,472.00	-
000793	华闻传媒	2015-05-26	重大事项	20.75	-	-	311,000.00	6,189,194.60	6,453,250.00	-
000818	方大化工	2015-06-08	重大事项	14.19	-	-	586,719.00	2,775,302.81	8,325,542.61	-
000839	中信国安	2015-06-29	重大事项	23.57	-	-	83,100.00	1,738,197.07	1,958,667.00	-
000881	大连国际	2015-04-22	重大事项	13.15	-	-	865,093.00	8,144,117.82	11,375,972.95	-
000889	茂业物流	2015-06-03	重大事项	23.00	2015-08-04	20.70	381,000.00	6,343,859.56	8,763,000.00	-
000903	云内动力	2015-06-02	重大事项	12.39	2015-07-27	11.10	930,611.00	9,025,046.45	11,530,270.29	-
000932	华菱钢铁	2015-05-14	重大事项	4.71	2015-07-16	4.24	660,922.00	3,259,533.97	3,112,942.62	-
000959	首钢股份	2015-04-23	重大事项	6.15	-	-	-2,285,217.00	9,371,321.38	14,054,084.55	-
000979	中弘股份	2015-05-25	重大事项	6.04	-	-	-1,669,920.00	8,243,931.00	10,086,316.80	-
002003	伟星股份	2015-06-05	重大事项	16.17	-	-	730,775.00	8,550,293.36	11,816,631.75	-
002012	凯恩股份	2015-05-28	重大事项	14.00	2015-07-01	12.60	689,500.00	5,181,937.51	9,653,000.00	-
002091	江苏国泰	2015-06-01	重大事项	26.22	-	-	226,626.00	3,960,930.11	5,942,133.72	-
002183	怡亚通	2015-06-01	重大事项	73.15	-	-	52,401.00	3,073,496.08	3,833,133.15	-
002200	云投生态	2015-05-29	重大事项	27.07	2015-07-17	24.36	371,446.00	9,636,134.08	10,055,043.22	-
002203	海亮股份	2015-04-27	重大事项	12.71	-	-	348,300.00	3,817,705.98	4,426,893.00	-
002238	天威视讯	2015-06-29	重大事项	23.76	-	-	190,510.00	4,774,090.28	4,526,517.60	-
002242	九阳股份	2015-06-15	重大事项	19.45	2015-07-07	17.51	15,200.00	253,202.04	295,640.00	-
002309	中利科技	2015-06-02	重大事项	33.39	2015-07-21	30.05	652,543.00	17,887,332.56	21,788,410.77	-
002310	东方园林	2015-05-27	重大事项	38.30	-	-	360,755.00	11,652,785.35	13,816,916.50	-
002320	海峡股份	2015-06-26	重大事项	27.43	-	-	206,850.00	3,199,580.44	5,673,895.50	-
002369	卓翼科技	2015-06-03	重大事项	20.03	-	-	156,161.00	2,411,557.69	3,127,904.83	-
002398	建研集团	2015-06-08	重大事项	28.49	2015-07-01	25.64	113,090.00	2,296,774.50	3,221,934.10	-
002406	远东传动	2015-06-30	重大事项	11.45	2015-07-01	12.00	178,700.00	2,017,721.78	2,046,115.00	-
002416	爱施德	2015-05-05	重大事项	20.67	2015-07-29	18.60	430,100.00	4,963,116.49	8,890,167.00	-
002461	珠江啤酒	2015-06-04	重大事项	26.40	2015-07-24	23.76	7,323.00	98,157.03	193,327.20	-
002498	汉缆股份	2015-06-30	重大事项	20.57	2015-07-20	22.63	310,700.00	2,667,519.69	6,391,099.00	-
002546	新联电子	2015-06-17	重大事项	33.16	2015-07-16	29.84	86,382.00	2,010,743.82	2,864,427.12	-
002557	洽洽食品	2015-06-29	重大事项	16.38	2015-08-24	14.74	681,107.00	10,512,560.02	11,156,532.66	-
002558	世纪游轮	2014-10-27	重大事项	31.65	-	-	24,213.00	723,425.35	766,341.45	-
002574	明牌珠宝	2015-06-05	重大事项	22.90	-	-	583,563.00	8,364,635.96	13,363,592.70	-
002575	群兴玩具	2015-06-01	重大事项	16.56	-	-	588,771.00	6,669,492.02	9,750,047.76	-
002665	首航节能	2015-06-30	重大事项	27.70	2015-07-01	30.00	138,550.00	4,070,040.73	3,837,835.00	-
002668	奥马电器	2015-06-29	重大事项	29.04	-	-	70,574.00	1,925,928.36	2,049,468.96	-
002670	华声股份	2015-04-13	重大事项	18.30	-	-	123,039.00	1,827,415.49	2,251,613.70	-
002671	龙泉股份	2015-06-17	重大事项	23.89	-	-	585,650.00	10,262,067.95	13,991,178.50	-
300047	天源迪科	2015-06-03	重大事项	35.88	2015-07-30	32.29	38,800.00	1,041,380.53	1,392,144.00	-
300056	三维丝	2015-06-05	重大事项	46.55	-	-	18,500.00	663,056.70	861,175.00	-
300071	华谊嘉信	2015-05-21	重大事项	13.66	-	-	38,700.00	516,840.00	528,642.00	-
300096	易联众	2015-05-28	重大事项	39.55	-	-	53,100.00	1,702,573.35	2,100,105.00	-

300142	沃森生物	2015-06-15	重大事项	48.70	-	-	224,040.00	6,416,382.75	10,910,748.00	-
300143	星河生物	2015-04-06	重大事项	19.23	2015-08-24	17.31	255,622.00	3,358,500.48	4,915,611.06	-
300158	振东制药	2015-04-27	重大事项	18.90	-	-	61.00	892.03	1,152.90	-
300161	华中数控	2015-05-22	重大事项	38.20	-	-	241,400.00	7,895,757.44	9,221,480.00	-
300195	长荣股份	2015-06-22	重大事项	31.96	2015-08-24	28.76	64,500.00	2,082,086.40	2,061,420.00	-
300197	铁汉生态	2015-06-16	重大事项	36.03	-	-	29,400.00	890,694.33	1,059,282.00	-
300212	易华录	2015-06-30	重大事项	59.94	2015-07-13	54.00	14,100.00	1,090,409.73	845,154.00	-
300214	日科化学	2015-05-18	重大事项	10.09	2015-07-22	9.22	865,687.00	7,929,169.05	8,734,781.83	-
300215	电科院	2015-06-16	重大事项	15.62	2015-07-28	14.06	161,500.00	2,066,542.64	2,522,630.00	-
300228	富瑞特装	2015-06-24	重大事项	90.91	2015-07-30	81.82	8,850.00	805,418.18	804,553.50	-
300287	飞利信	2015-06-02	重大事项	54.26	-	-	51,200.00	2,335,073.84	2,778,112.00	-
300291	华录百纳	2015-06-30	重大事项	37.76	2015-07-13	34.65	12,300.00	570,066.29	464,448.00	-
300346	南大光电	2015-06-25	重大事项	35.49	-	-	226,939.00	6,895,878.79	8,054,065.11	-
300418	昆仑万维	2015-05-05	重大事项	155.91	2015-08-06	140.09	500.00	10,150.00	77,955.00	-
300427	红相电力	2015-06-30	重大事项	64.64	-	-	500.00	5,230.00	32,320.00	-
600053	中江地产	2015-03-23	重大事项	13.14	-	-	949,070.00	11,674,880.62	12,470,779.80	-
600078	澄星股份	2015-06-09	重大事项	15.23	2015-07-01	13.71	43,588.00	451,844.70	663,845.24	-
600110	中科英华	2015-06-26	重大事项	13.73	-	-	6,500.00	69,458.46	89,245.00	-
600153	建发股份	2015-06-29	重大事项	17.51	-	-	469,179.00	6,375,752.44	8,215,324.29	-
600167	联美控股	2015-05-27	重大事项	25.76	-	-	127,425.00	2,547,014.78	3,282,468.00	-
600246	万通地产	2015-01-06	重大事项	5.32	2015-07-06	5.85	1,418,627.00	5,503,515.90	7,547,095.64	-
600277	亿利能源	2015-05-29	重大事项	14.62	-	-	708,200.00	7,360,116.61	10,353,884.00	-
600310	桂东电力	2015-06-30	重大事项	31.53	2015-07-13	34.68	162,060.00	6,796,845.34	5,109,751.80	-
600333	长春燃气	2015-05-29	重大事项	11.97	2015-07-09	10.77	65,703.00	545,328.10	786,464.91	-
600335	国机汽车	2015-06-15	重大事项	37.93	2015-07-21	33.94	222,700.00	5,167,288.11	8,447,011.00	-
600395	盘江股份	2015-06-09	重大事项	15.71	2015-08-19	13.88	649,580.00	8,972,294.42	10,204,901.80	-
600408	安泰集团	2015-04-24	重大事项	6.16	-	-	1,934,568.00	7,018,134.25	11,916,938.88	-
600410	华胜天成	2015-05-28	重大事项	47.84	2015-07-23	38.75	16,100.00	635,687.07	770,224.00	-
600531	豫光金铅	2015-06-11	重大事项	27.53	2015-07-03	24.78	110,230.00	2,084,322.64	3,034,631.90	-
600589	广东榕泰	2015-04-14	重大事项	10.84	-	-	401,472.00	3,220,955.64	4,351,956.48	-
600622	嘉宝集团	2015-05-26	重大事项	13.86	2015-07-02	12.26	228,312.00	2,107,476.41	3,164,404.32	-
600641	万业企业	2015-06-12	重大事项	11.23	-	-	262,089.00	1,691,716.63	2,943,259.47	-
600643	爱建股份	2015-06-30	重大事项	16.73	-	-	323,647.00	5,515,519.83	5,414,614.31	-
600702	沱牌舍得	2015-06-29	重大事项	26.11	2015-08-20	28.00	27,100.00	649,025.20	707,581.00	-
600719	大连热电	2015-03-26	重大事项	10.76	-	-	354,481.00	3,450,983.03	3,814,215.56	-
600790	轻纺城	2015-05-25	重大事项	13.38	2015-08-18	12.04	869,525.00	8,918,759.49	11,634,244.50	-
600879	航天电子	2015-05-15	重大事项	24.50	-	-	97,982.00	1,587,325.09	2,400,559.00	-
600886	国投电力	2015-06-24	重大事项	14.87	-	-	409,066.00	3,772,893.36	6,082,811.42	-
601111	中国国航	2015-06-30	重大事项	15.36	2015-07-29	13.78	202,651.00	2,306,316.61	3,112,719.36	-
601311	骆驼股份	2015-06-18	重大事项	28.20	2015-07-15	25.38	228,873.00	3,741,829.42	6,454,218.60	-
601633	长城汽车	2015-06-19	重大事项	42.76	2015-07-13	38.50	154,532.00	7,388,113.11	6,607,788.32	-
603885	吉祥航空	2015-06-29	重大事项	68.96	2015-07-15	62.06	1,000.00	11,180.00	68,960.00	-
002292	奥飞动漫	2015-05-18	重大事项	37.29	-	-	953,854.00	18,839,459.89	35,569,215.66	-
300144	宋城演艺	2015-06-18	重大事项	56.66	2015-07-20	68.82	26,750.00	1,239,715.95	1,515,655.00	-

000878	云南铜业	2015-06-08	重大事项	18.52	-	-	-1,404,227.00	18,668,039.19	26,006,284.04	-
002191	劲嘉股份	2015-06-18	重大事项	15.77	-	-	369,700.00	3,152,611.66	5,830,169.00	-
000963	华东医药	2015-06-26	重大事项	62.50	2015-08-05	69.20	199,762.00	14,101,626.46	12,485,125.00	-
002194	武汉凡谷	2015-06-18	重大事项	21.08	2015-07-24	24.28	47,953.00	582,912.89	1,010,849.24	-
300012	华测检测	2015-06-15	重大事项	30.80	2015-07-27	38.76	12,200.00	428,676.97	375,760.00	-
002662	京威股份	2015-05-15	重大事项	17.82	2015-08-13	16.06	656,457.00	11,097,289.45	11,698,063.74	-

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未有银行间市场债券正回购。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未有交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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工作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。

6.4.13.2 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、且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值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。

6.4.13.3 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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此，本期末本基金的资产均能及时变现。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30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	455,648,414.21	-	-	-	-	-	455,648,414.21
结算备付金	33,604,804.00	-	-	-	-	-	33,604,804.00
存出保证金	4,379,606.31	-	-	-	-	-	4,379,606.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,441,945,827.00	4,441,945,827.00
应收利息	-	-	-	-	-	100,490.82	100,490.82
应收申购款	11,472.87	-	-	-	-	5,512,888.40	5,524,361.27
资产总计	493,644,297.39	-	-	-	-	4,447,559,206.22	4,941,203,503.61
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	166,101,925.09	166,101,925.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,373,316.53	7,373,316.53
应付托管费	-	-	-	-	-	1,228,886.09	1,228,886.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	17,567,856.01	17,567,856.01
其他负债	-	-	-	-	-	278,732.67	278,732.67
负债总计	-	-	-	-	-	192,550,716.39	192,550,716.39
利率敏感度缺口	493,644,297.39	-	-	-	-	4,255,008,489.83	4,748,652,787.22
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
利率敏感度缺口	668,623,565.33	-	-	-	-	7,448,028,842.04	8,116,652,407.37

注：（1）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。

（2）若干比较数据已进行重述，以符合本年度之列报要求。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30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	4,441,945,827.00	93.54	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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,441,945,827.00	93.54	7,508,779,565.78	92.51

6.4.13.4.3.2 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 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 4,362	增加约 6,393
	业绩比较基准下降 1%	减少约 4,362	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 投资组合报告

7.1 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	4,441,945,827.00	89.90
	其中: 股票	4,441,945,827.00	89.90
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	489,253,218.21	9.90
7	其他各项资产	10,004,458.40	0.20
8	合计	4,941,203,503.61	100.00

7.2 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	66,139,948.28	1.39
B	采矿业	154,049,368.99	3.24
C	制造业	2,445,224,062.67	51.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	144,171,629.23	3.04
E	建筑业	161,362,318.77	3.40
F	批发和零售业	265,788,441.85	5.60
G	交通运输、仓储和邮政业	180,442,002.06	3.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	112,925,618.65	2.38
J	金融业	471,990,192.00	9.94
K	房地产业	277,386,191.51	5.84
L	租赁和商务服务业	50,899,265.42	1.07
M	科学研究和技术服务业	6,888,924.10	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	34,259,567.13	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,262,735.52	0.05
R	文化、体育和娱乐业	35,272,043.87	0.74
S	综合	32,883,516.95	0.69
	合计	4,441,945,827.00	93.54

7.3 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	600036	招商银行	3,117,007	58,350,371.04	1.23
2	000039	中集集团	1,371,908	44,312,628.40	0.93
3	601009	南京银行	1,921,272	43,805,001.60	0.92
4	000778	新兴铸管	3,124,780	40,497,148.80	0.85
5	000686	东北证券	2,059,836	40,105,006.92	0.84
6	601668	中国建筑	4,283,039	35,592,054.09	0.75
7	002292	奥飞动漫	953,854	35,569,215.66	0.75
8	002429	兆驰股份	2,694,179	34,754,909.10	0.73
9	600422	昆药集团	880,328	32,510,513.04	0.68
10	600648	外高桥	926,719	32,509,302.52	0.68
11	600015	华夏银行	2,124,195	32,309,005.95	0.68
12	601328	交通银行	3,507,258	28,899,805.92	0.61
13	000021	深科技	1,738,295	26,508,998.75	0.56
14	000878	云南铜业	1,404,227	26,006,284.04	0.55
15	600029	南方航空	1,739,764	25,296,168.56	0.53
16	601766	中国南车	1,357,433	24,922,469.88	0.52
17	600837	海通证券	1,138,087	24,810,296.60	0.52
18	000100	TCL 集团	4,145,164	23,420,176.60	0.49
19	601939	建设银行	3,121,150	22,253,799.50	0.47
20	000750	国海证券	1,318,373	22,148,666.40	0.47
21	002410	广联达	944,785	22,107,969.00	0.47
22	600143	金发科技	1,840,315	21,936,554.80	0.46
23	002309	中利科技	652,543	21,788,410.77	0.46
24	002714	牧原股份	335,974	19,735,112.76	0.42
25	600325	华发股份	1,073,533	19,430,947.30	0.41
26	002630	华西能源	701,600	18,950,216.00	0.40
27	000426	兴业矿业	1,113,808	18,388,970.08	0.39
28	600016	民生银行	1,836,312	18,252,941.28	0.38
29	000568	泸州老窖	545,887	17,801,375.07	0.37
30	002482	广田股份	650,468	17,757,776.40	0.37
31	000776	广发证券	783,746	17,751,846.90	0.37
32	600115	东方航空	1,408,084	17,347,594.88	0.37
33	600426	华鲁恒升	932,063	17,299,089.28	0.36
34	600521	华海药业	526,191	16,443,468.75	0.35
35	600004	白云机场	955,394	16,146,158.60	0.34
36	000501	鄂武商 A	781,177	16,014,128.50	0.34
37	000543	皖能电力	731,438	15,623,515.68	0.33
38	002595	豪迈科技	719,976	15,537,082.08	0.33

39	600066	宇通客车	751,252	15,438,228.60	0.33
40	000572	海马汽车	1,758,684	14,755,358.76	0.31
41	000623	吉林敖东	436,378	14,662,300.80	0.31
42	600221	海南航空	2,286,600	14,611,374.00	0.31
43	002202	金风科技	750,040	14,603,278.80	0.31
44	600298	安琪酵母	419,153	14,578,141.34	0.31
45	002635	安洁科技	590,940	14,389,389.00	0.30
46	000959	首钢股份	2,285,217	14,054,084.55	0.30
47	600038	中直股份	226,366	14,023,373.70	0.30
48	002671	龙泉股份	585,650	13,991,178.50	0.29
49	002607	亚夏汽车	1,313,854	13,939,990.94	0.29
50	002310	东方园林	360,755	13,816,916.50	0.29
51	000786	北新建材	738,400	13,719,472.00	0.29
52	000506	中润资源	913,791	13,716,002.91	0.29
53	600741	华域汽车	642,113	13,709,112.55	0.29
54	000951	中国重汽	473,272	13,639,699.04	0.29
55	600006	东风汽车	1,075,586	13,638,430.48	0.29
56	002574	明牌珠宝	583,563	13,363,592.70	0.28
57	000418	小天鹅 A	554,262	13,246,861.80	0.28
58	600369	西南证券	666,559	13,097,884.35	0.28
59	600348	阳泉煤业	1,245,185	12,763,146.25	0.27
60	000685	中山公用	431,499	12,699,015.57	0.27
61	600563	法拉电子	409,134	12,662,697.30	0.27
62	000963	华东医药	199,762	12,485,125.00	0.26
63	600053	中江地产	949,070	12,470,779.80	0.26
64	601965	中国汽研	952,877	12,396,929.77	0.26
65	600011	华能国际	877,901	12,316,951.03	0.26
66	600239	云南城投	1,296,168	12,313,596.00	0.26
67	002142	宁波银行	565,063	11,951,082.45	0.25
68	000926	福星股份	845,245	11,926,406.95	0.25
69	600408	安泰集团	1,934,568	11,916,938.88	0.25
70	600199	金种子酒	848,919	11,884,866.00	0.25
71	002014	永新股份	490,486	11,879,570.92	0.25
72	002003	伟星股份	730,775	11,816,631.75	0.25
73	600873	梅花生物	1,127,245	11,768,437.80	0.25
74	002662	京威股份	656,457	11,698,063.74	0.25
75	600790	轻纺城	869,525	11,634,244.50	0.25
76	000903	云内动力	930,611	11,530,270.29	0.24
77	000881	大连国际	865,093	11,375,972.95	0.24
78	002233	塔牌集团	654,788	11,301,640.88	0.24
79	000876	新希望	577,368	11,206,712.88	0.24
80	002557	洽洽食品	681,107	11,156,532.66	0.23
81	000780	平庄能源	1,194,863	11,136,123.16	0.23
82	600058	五矿发展	340,563	11,126,193.21	0.23

83	600376	首开股份	575,821	11,107,587.09	0.23
84	600176	中国巨石	409,913	11,092,245.78	0.23
85	600583	海油工程	663,466	11,053,343.56	0.23
86	600801	华新水泥	1,035,150	10,941,535.50	0.23
87	300142	沃森生物	224,040	10,910,748.00	0.23
88	000639	西王食品	474,161	10,834,578.85	0.23
89	000612	焦作万方	986,628	10,773,977.76	0.23
90	000533	万 家 乐	857,800	10,713,922.00	0.23
91	002244	滨江集团	573,540	10,558,871.40	0.22
92	000716	黑芝麻	444,014	10,518,691.66	0.22
93	000156	华数传媒	290,814	10,405,324.92	0.22
94	002674	兴业科技	571,080	10,382,234.40	0.22
95	600277	亿利能源	708,200	10,353,884.00	0.22
96	600395	盘江股份	649,580	10,204,901.80	0.21
97	600141	兴发集团	587,247	10,118,265.81	0.21
98	000979	中弘股份	1,669,920	10,086,316.80	0.21
99	000957	中通客车	417,442	10,072,875.46	0.21
100	002200	云投生态	371,446	10,055,043.22	0.21
101	600084	中葡股份	729,500	10,052,510.00	0.21
102	600761	安徽合力	598,245	10,008,638.85	0.21
103	002565	上海绿新	995,475	10,004,523.75	0.21
104	600409	三友化工	869,000	9,819,700.00	0.21
105	600005	武钢股份	1,394,300	9,801,929.00	0.21
106	002575	群兴玩具	588,771	9,750,047.76	0.21
107	000933	神火股份	1,034,937	9,749,106.54	0.21
108	300026	红日药业	432,808	9,712,211.52	0.20
109	601988	中国银行	1,976,219	9,663,710.91	0.20
110	002012	凯恩股份	689,500	9,653,000.00	0.20
111	600485	信威集团	219,555	9,636,268.95	0.20
112	000402	金 融 街	680,072	9,609,417.36	0.20
113	600000	浦发银行	565,654	9,593,491.84	0.20
114	600655	豫园商城	593,301	9,522,481.05	0.20
115	601233	桐昆股份	474,831	9,477,626.76	0.20
116	002249	大洋电机	738,700	9,470,134.00	0.20
117	300161	华中数控	241,400	9,221,480.00	0.19
118	000726	鲁 泰 A	662,440	9,207,916.00	0.19
119	002008	大族激光	318,695	9,152,920.40	0.19
120	000530	大冷股份	538,937	9,134,982.15	0.19
121	002449	国星光电	414,523	9,119,506.00	0.19
122	600351	亚宝药业	669,690	9,067,602.60	0.19
123	000729	燕京啤酒	867,904	9,026,201.60	0.19
124	601398	工商银行	1,708,065	9,018,583.20	0.19
125	000861	海印股份	415,200	8,922,648.00	0.19
126	601998	中信银行	1,154,901	8,904,286.71	0.19

127	002416	爱施德	430,100	8,890,167.00	0.19
128	600383	金地集团	695,993	8,804,311.45	0.19
129	300037	新宙邦	230,049	8,803,975.23	0.19
130	600674	川投能源	701,904	8,780,819.04	0.18
131	601288	农业银行	2,364,088	8,770,766.48	0.18
132	000889	茂业物流	381,000	8,763,000.00	0.18
133	300214	日科化学	865,687	8,734,781.83	0.18
134	000042	中洲控股	357,596	8,728,918.36	0.18
135	600823	世茂股份	668,148	8,705,968.44	0.18
136	000045	深纺织 A	489,223	8,703,277.17	0.18
137	000759	中百集团	725,371	8,682,690.87	0.18
138	600350	山东高速	1,014,046	8,680,233.76	0.18
139	600723	首商股份	700,821	8,641,122.93	0.18
140	002083	孚日股份	982,818	8,619,313.86	0.18
141	601011	宝泰隆	585,417	8,593,921.56	0.18
142	000918	嘉凯城	1,117,285	8,591,921.65	0.18
143	600266	北京城建	388,688	8,586,117.92	0.18
144	000404	华意压缩	752,762	8,581,486.80	0.18
145	300101	振芯科技	154,328	8,580,636.80	0.18
146	600651	飞乐音响	415,706	8,551,072.42	0.18
147	002314	雅致股份	664,584	8,519,966.88	0.18
148	600858	银座股份	620,541	8,513,822.52	0.18
149	000301	东方市场	1,014,717	8,493,181.29	0.18
150	000581	威孚高科	273,537	8,476,911.63	0.18
151	600335	国机汽车	222,700	8,447,011.00	0.18
152	000006	深振业 A	621,700	8,436,469.00	0.18
153	601886	江河创建	566,955	8,436,290.40	0.18
154	000550	江铃汽车	229,814	8,434,173.80	0.18
155	002031	巨轮股份	529,115	8,434,093.10	0.18
156	600418	江淮汽车	597,250	8,409,280.00	0.18
157	002284	亚太股份	333,985	8,393,043.05	0.18
158	002062	宏润建设	732,414	8,371,492.02	0.18
159	600983	惠而浦	524,283	8,330,856.87	0.18
160	000818	方大化工	586,719	8,325,542.61	0.18
161	600159	大龙地产	1,013,000	8,286,340.00	0.17
162	600694	大商股份	149,300	8,253,304.00	0.17
163	601006	大秦铁路	587,297	8,245,649.88	0.17
164	600153	建发股份	469,179	8,215,324.29	0.17
165	000001	平安银行	563,100	8,187,474.00	0.17
166	300059	东方财富	129,138	8,147,316.42	0.17
167	600138	中青旅	385,600	8,143,872.00	0.17
168	002360	同德化工	454,700	8,093,660.00	0.17
169	000809	铁岭新城	706,790	8,092,745.50	0.17
170	600104	上汽集团	357,563	8,080,923.80	0.17

171	000792	盐湖股份	284,159	8,064,432.42	0.17
172	300346	南大光电	226,939	8,054,065.11	0.17
173	600497	驰宏锌锗	551,248	8,042,708.32	0.17
174	600230	沧州大化	511,721	8,039,136.91	0.17
175	000056	深国商	268,753	8,019,589.52	0.17
176	600805	悦达投资	512,355	8,008,108.65	0.17
177	600020	中原高速	1,076,240	7,985,700.80	0.17
178	000525	红太阳	356,931	7,984,546.47	0.17
179	002372	伟星新材	446,886	7,941,164.22	0.17
180	002403	爱仕达	338,925	7,917,288.00	0.17
181	600051	宁波联合	543,281	7,893,872.93	0.17
182	600750	江中药业	245,017	7,887,097.23	0.17
183	601992	金隅股份	659,821	7,884,860.95	0.17
184	600289	亿阳信通	395,294	7,878,209.42	0.17
185	600068	葛洲坝	672,430	7,860,706.70	0.17
186	002028	思源电气	426,358	7,844,987.20	0.17
187	600449	宁夏建材	606,754	7,833,194.14	0.16
188	600022	山东钢铁	1,343,700	7,806,897.00	0.16
189	600375	华菱星马	584,277	7,800,097.95	0.16
190	000877	天山股份	665,483	7,799,460.76	0.16
191	601058	赛轮金宇	699,385	7,798,142.75	0.16
192	002536	西泵股份	153,553	7,780,530.51	0.16
193	600765	中航重机	283,200	7,768,176.00	0.16
194	600601	方正科技	851,400	7,747,740.00	0.16
195	000860	顺鑫农业	335,164	7,678,607.24	0.16
196	600438	通威股份	487,618	7,670,231.14	0.16
197	002440	闰土股份	319,737	7,664,095.89	0.16
198	600048	保利地产	670,238	7,654,117.96	0.16
199	300237	美晨科技	232,902	7,632,198.54	0.16
200	002321	华英农业	619,819	7,611,377.32	0.16
201	002299	圣农发展	371,820	7,547,946.00	0.16
202	600246	万通地产	1,418,627	7,547,095.64	0.16
203	002063	远光软件	240,871	7,532,036.17	0.16
204	600657	信达地产	911,997	7,514,855.28	0.16
205	600546	山煤国际	882,586	7,510,806.86	0.16
206	600697	欧亚集团	242,260	7,505,214.80	0.16
207	600177	雅戈尔	410,201	7,490,270.26	0.16
208	600323	瀚蓝环境	432,588	7,475,120.64	0.16
209	000830	鲁西化工	749,926	7,469,262.96	0.16
210	000789	万年青	718,314	7,434,549.90	0.16
211	000703	恒逸石化	580,686	7,409,553.36	0.16
212	600797	浙大网新	391,494	7,395,321.66	0.16
213	601636	旗滨集团	689,101	7,394,053.73	0.16
214	600377	宁沪高速	763,799	7,393,574.32	0.16

215	002054	德美化工	648,084	7,375,195.92	0.16
216	600987	航民股份	543,137	7,364,937.72	0.16
217	002588	史丹利	256,067	7,361,926.25	0.16
218	601126	四方股份	240,472	7,334,396.00	0.15
219	603001	奥康国际	234,834	7,331,517.48	0.15
220	600742	一汽富维	238,607	7,272,741.36	0.15
221	000800	一汽轿车	291,100	7,242,568.00	0.15
222	000900	现代投资	703,959	7,222,619.34	0.15
223	000030	富奥股份	624,220	7,222,225.40	0.15
224	600039	四川路桥	1,106,000	7,222,180.00	0.15
225	600509	天富能源	513,022	7,218,219.54	0.15
226	601339	百隆东方	743,680	7,213,696.00	0.15
227	600057	象屿股份	507,408	7,189,971.36	0.15
228	601677	明泰铝业	438,958	7,185,742.46	0.15
229	600059	古越龙山	468,499	7,177,404.68	0.15
230	300345	红宇新材	168,780	7,176,525.60	0.15
231	601107	四川成渝	1,040,116	7,166,399.24	0.15
232	002539	新都化工	217,377	7,151,703.30	0.15
233	601313	江南嘉捷	380,859	7,125,871.89	0.15
234	600896	中海海盛	441,593	7,114,063.23	0.15
235	000488	晨鸣纸业	791,764	7,102,123.08	0.15
236	000732	泰禾集团	206,634	7,066,882.80	0.15
237	603766	隆鑫通用	281,367	7,062,311.70	0.15
238	300152	燃控科技	153,900	7,040,925.00	0.15
239	601177	杭齿前进	572,615	7,014,533.75	0.15
240	000733	振华科技	259,890	7,014,431.10	0.15
241	000666	经纬纺机	347,428	6,969,405.68	0.15
242	600642	申能股份	693,300	6,939,933.00	0.15
243	000910	大亚科技	407,577	6,936,960.54	0.15
244	002082	栋梁新材	479,977	6,906,869.03	0.15
245	601377	兴业证券	502,900	6,884,701.00	0.14
246	600720	祁连山	650,093	6,884,484.87	0.14
247	002454	松芝股份	315,400	6,844,180.00	0.14
248	601336	新华保险	112,000	6,838,720.00	0.14
249	600486	扬农化工	189,511	6,818,605.78	0.14
250	000911	南宁糖业	397,607	6,814,983.98	0.14
251	600717	天津港	454,100	6,806,959.00	0.14
252	600693	东百集团	544,335	6,776,970.75	0.14
253	002073	软控股份	293,019	6,768,738.90	0.14
254	600467	好当家	720,311	6,756,517.18	0.14
255	300107	建新股份	781,515	6,736,659.30	0.14
256	300066	三川股份	422,710	6,666,136.70	0.14
257	601633	长城汽车	154,532	6,607,788.32	0.14
258	000423	东阿阿胶	120,928	6,590,576.00	0.14

259	601318	中国平安	79,600	6,522,424.00	0.14
260	300325	德威新材	371,136	6,494,880.00	0.14
261	002048	宁波华翔	311,325	6,472,446.75	0.14
262	601311	骆驼股份	228,873	6,454,218.60	0.14
263	000793	华闻传媒	311,000	6,453,250.00	0.14
264	600425	青松建化	653,820	6,420,512.40	0.14
265	002363	隆基机械	189,873	6,419,606.13	0.14
266	000625	长安汽车	302,318	6,394,025.70	0.13
267	601166	兴业银行	370,500	6,391,125.00	0.13
268	002498	汉缆股份	310,700	6,391,099.00	0.13
269	601100	恒立油缸	350,176	6,383,708.48	0.13
270	600724	宁波富达	656,900	6,378,499.00	0.13
271	600403	大有能源	713,003	6,374,246.82	0.13
272	002521	齐峰新材	456,470	6,354,062.40	0.13
273	300090	盛运环保	283,316	6,295,281.52	0.13
274	002537	海立美达	403,226	6,294,357.86	0.13
275	000669	金鸿能源	166,702	6,287,999.44	0.13
276	600827	百联股份	301,911	6,282,767.91	0.13
277	300258	精锻科技	402,778	6,263,197.90	0.13
278	300180	华峰超纤	457,035	6,261,379.50	0.13
279	601601	中国太保	207,320	6,256,917.60	0.13
280	002500	山西证券	344,800	6,237,432.00	0.13
281	600117	西宁特钢	619,300	6,236,351.00	0.13
282	600616	金枫酒业	396,966	6,228,396.54	0.13
283	300138	晨光生物	371,137	6,227,678.86	0.13
284	002567	唐人神	504,345	6,203,443.50	0.13
285	601117	中国化学	632,724	6,188,040.72	0.13
286	002394	联发股份	398,524	6,169,151.52	0.13
287	600496	精工钢构	843,747	6,167,790.57	0.13
288	600397	安源煤业	635,500	6,145,285.00	0.13
289	002050	三花股份	534,100	6,136,809.00	0.13
290	600597	光明乳业	265,900	6,115,700.00	0.13
291	600188	兖州煤业	443,607	6,099,596.25	0.13
292	600886	国投电力	409,066	6,082,811.42	0.13
293	000916	华北高速	728,000	6,056,960.00	0.13
294	600540	新赛股份	449,410	6,049,058.60	0.13
295	600270	外运发展	206,113	6,010,255.08	0.13
296	000401	冀东水泥	456,322	6,000,634.30	0.13
297	601179	中国西电	583,963	5,985,620.75	0.13
298	601628	中国人寿	190,355	5,961,918.60	0.13
299	002091	江苏国泰	226,626	5,942,133.72	0.13
300	600971	恒源煤电	647,800	5,927,370.00	0.12
301	000978	桂林旅游	389,701	5,923,455.20	0.12
302	300050	世纪鼎利	206,508	5,889,608.16	0.12

303	000883	湖北能源	674,200	5,879,024.00	0.12
304	002673	西部证券	207,220	5,878,831.40	0.12
305	002126	银轮股份	291,196	5,870,511.36	0.12
306	600572	康恩贝	257,130	5,836,851.00	0.12
307	002191	劲嘉股份	369,700	5,830,169.00	0.12
308	600311	荣华实业	591,600	5,821,344.00	0.12
309	000159	国际实业	469,800	5,806,728.00	0.12
310	002347	泰尔重工	237,419	5,804,894.55	0.12
311	600208	新湖中宝	750,900	5,796,948.00	0.12
312	600030	中信证券	214,800	5,780,268.00	0.12
313	600585	海螺水泥	269,204	5,774,425.80	0.12
314	600686	金龙汽车	224,100	5,768,334.00	0.12
315	002597	金禾实业	470,251	5,751,169.73	0.12
316	000089	深圳机场	507,771	5,727,656.88	0.12
317	002623	亚玛顿	130,769	5,701,528.40	0.12
318	600216	浙江医药	427,800	5,681,184.00	0.12
319	002320	海峡股份	206,850	5,673,895.50	0.12
320	601901	方正证券	474,476	5,641,519.64	0.12
321	600999	招商证券	213,200	5,641,272.00	0.12
322	000551	创元科技	387,250	5,564,782.50	0.12
323	000425	徐工机械	419,100	5,561,457.00	0.12
324	000961	中南建设	278,100	5,553,657.00	0.12
325	300283	温州宏丰	400,203	5,550,815.61	0.12
326	600081	东风科技	260,600	5,527,326.00	0.12
327	300194	福安药业	208,943	5,526,542.35	0.12
328	000712	锦龙股份	157,209	5,518,035.90	0.12
329	300038	梅泰诺	122,500	5,510,050.00	0.12
330	600580	卧龙电气	308,210	5,495,384.30	0.12
331	601258	庞大集团	1,002,142	5,471,695.32	0.12
332	600830	香溢融通	354,120	5,471,154.00	0.12
333	000069	华侨城 A	418,584	5,433,220.32	0.11
334	600643	爱建股份	323,647	5,414,614.31	0.11
335	601958	金钼股份	457,500	5,389,350.00	0.11
336	002466	天齐锂业	87,108	5,383,274.40	0.11
337	002059	云南旅游	442,476	5,367,233.88	0.11
338	601888	中国国旅	80,904	5,363,935.20	0.11
339	002290	禾盛新材	148,838	5,341,795.82	0.11
340	600073	上海梅林	412,051	5,331,939.94	0.11
341	002317	众生药业	189,079	5,330,137.01	0.11
342	600215	长春经开	489,300	5,318,691.00	0.11
343	000650	仁和药业	308,454	5,296,155.18	0.11
344	002187	广百股份	282,771	5,287,817.70	0.11
345	600439	瑞贝卡	606,382	5,287,651.04	0.11
346	600184	光电股份	185,772	5,231,339.52	0.11

347	002496	辉丰股份	194,575	5,224,338.75	0.11
348	601001	大同煤业	564,967	5,220,295.08	0.11
349	600884	杉杉股份	182,451	5,218,098.60	0.11
350	600278	东方创业	257,600	5,213,824.00	0.11
351	000528	柳 工	440,700	5,209,074.00	0.11
352	002419	天虹商场	305,275	5,189,675.00	0.11
353	600261	阳光照明	637,050	5,179,216.50	0.11
354	300004	南风股份	76,132	5,176,976.00	0.11
355	002563	森马服饰	213,600	5,160,576.00	0.11
356	002538	司尔特	385,600	5,132,336.00	0.11
357	000651	格力电器	80,222	5,126,185.80	0.11
358	600582	天地科技	299,600	5,120,164.00	0.11
359	002011	盾安环境	352,942	5,114,129.58	0.11
360	600310	桂东电力	162,060	5,109,751.80	0.11
361	300307	慈星股份	312,799	5,089,239.73	0.11
362	600660	福耀玻璃	352,300	5,030,844.00	0.11
363	600240	华业地产	328,026	5,005,676.76	0.11
364	002433	太安堂	309,638	5,003,750.08	0.11
365	002408	齐翔腾达	291,338	4,993,533.32	0.11
366	002213	特 尔 佳	320,300	4,967,853.00	0.10
367	300073	当升科技	183,330	4,920,577.20	0.10
368	300143	星河生物	255,622	4,915,611.06	0.10
369	300118	东方日升	406,600	4,891,398.00	0.10
370	002053	云南盐化	170,354	4,890,863.34	0.10
371	002311	海大集团	354,521	4,888,844.59	0.10
372	002463	沪电股份	584,500	4,880,575.00	0.10
373	002037	久联发展	143,718	4,837,547.88	0.10
374	000026	飞亚达 A	268,920	4,786,776.00	0.10
375	002051	中工国际	160,389	4,776,384.42	0.10
376	002275	桂林三金	186,733	4,772,895.48	0.10
377	300027	华谊兄弟	124,400	4,744,616.00	0.10
378	600491	龙元建设	397,700	4,692,860.00	0.10
379	002281	光迅科技	97,552	4,690,300.16	0.10
380	600129	太极集团	172,257	4,688,835.54	0.10
381	300040	九洲电气	361,848	4,682,313.12	0.10
382	300160	秀强股份	202,819	4,644,555.10	0.10
383	600894	广日股份	231,900	4,628,724.00	0.10
384	300082	奥克股份	478,692	4,619,377.80	0.10
385	600739	辽宁成大	188,710	4,613,959.50	0.10
386	002174	游族网络	49,400	4,582,344.00	0.10
387	002580	圣阳股份	256,603	4,552,137.22	0.10
388	601678	滨化股份	505,442	4,533,814.74	0.10
389	000681	视觉中国	110,290	4,528,507.40	0.10
390	002238	天威视讯	190,510	4,526,517.60	0.10

391	601222	林洋电子	128,376	4,504,713.84	0.09
392	600150	中国船舶	87,373	4,499,709.50	0.09
393	300340	科恒股份	136,600	4,466,820.00	0.09
394	600851	海欣股份	352,800	4,466,448.00	0.09
395	300150	世纪瑞尔	332,800	4,432,896.00	0.09
396	002203	海亮股份	348,300	4,426,893.00	0.09
397	601390	中国中铁	322,811	4,419,282.59	0.09
398	300241	瑞丰光电	262,150	4,385,769.50	0.09
399	002294	信立泰	152,954	4,374,484.40	0.09
400	600589	广东榕泰	401,472	4,351,956.48	0.09
401	300100	双林股份	227,989	4,338,630.67	0.09
402	000950	建峰化工	458,919	4,327,606.17	0.09
403	000429	粤高速 A	658,383	4,226,818.86	0.09
404	600729	重庆百货	131,200	4,222,016.00	0.09
405	002128	露天煤业	253,609	4,179,476.32	0.09
406	600162	香江控股	355,617	4,171,387.41	0.09
407	600747	大连控股	520,000	4,123,600.00	0.09
408	600844	丹化科技	381,187	4,071,077.16	0.09
409	600458	时代新材	160,420	4,026,542.00	0.08
410	300309	吉艾科技	267,324	4,009,860.00	0.08
411	000758	中色股份	202,496	3,974,996.48	0.08
412	300204	舒泰神	112,431	3,863,129.16	0.08
413	002665	首航节能	138,550	3,837,835.00	0.08
414	002183	怡亚通	52,401	3,833,133.15	0.08
415	600859	王府井	121,100	3,814,650.00	0.08
416	600719	大连热电	354,481	3,814,215.56	0.08
417	600488	天药股份	393,550	3,813,499.50	0.08
418	002494	华斯股份	168,876	3,779,444.88	0.08
419	000158	常山股份	172,497	3,777,684.30	0.08
420	000690	宝新能源	287,626	3,638,468.90	0.08
421	300024	机器人	46,400	3,584,864.00	0.08
422	002327	富安娜	283,358	3,496,637.72	0.07
423	000536	华映科技	198,810	3,479,175.00	0.07
424	002427	尤夫股份	165,224	3,458,138.32	0.07
425	002490	山东墨龙	285,936	3,434,091.36	0.07
426	002392	北京利尔	394,854	3,411,538.56	0.07
427	600487	亨通光电	91,374	3,362,563.20	0.07
428	600167	联美控股	127,425	3,282,468.00	0.07
429	601088	中国神华	155,200	3,235,920.00	0.07
430	000608	阳光股份	392,902	3,233,583.46	0.07
431	000886	海南高速	381,965	3,223,784.60	0.07
432	002398	建研集团	113,090	3,221,934.10	0.07
433	002225	濮耐股份	335,866	3,177,292.36	0.07
434	600622	嘉宝集团	228,312	3,164,404.32	0.07

435	002369	卓翼科技	156,161	3,127,904.83	0.07
436	000932	华菱钢铁	660,922	3,112,942.62	0.07
437	601111	中国国航	202,651	3,112,719.36	0.07
438	600649	城投控股	330,600	3,091,110.00	0.07
439	601777	力帆股份	195,493	3,086,834.47	0.07
440	600429	三元股份	271,300	3,062,977.00	0.06
441	600887	伊利股份	161,862	3,059,191.80	0.06
442	600062	华润双鹤	117,300	3,054,492.00	0.06
443	000672	上峰水泥	252,000	3,036,600.00	0.06
444	600531	豫光金铅	110,230	3,034,631.90	0.06
445	000981	银亿股份	117,677	2,988,995.80	0.06
446	000519	江南红箭	113,700	2,963,022.00	0.06
447	600736	苏州高新	258,827	2,948,039.53	0.06
448	600641	万业企业	262,089	2,943,259.47	0.06
449	601208	东材科技	257,007	2,935,019.94	0.06
450	002458	益生股份	111,801	2,922,478.14	0.06
451	002546	新联电子	86,382	2,864,427.12	0.06
452	600428	中远航运	175,341	2,838,770.79	0.06
453	600570	恒生电子	25,063	2,808,309.15	0.06
454	000090	天健集团	115,600	2,803,300.00	0.06
455	002068	黑猫股份	283,565	2,784,608.30	0.06
456	300287	飞利信	51,200	2,778,112.00	0.06
457	600118	中国卫星	48,100	2,739,776.00	0.06
458	601098	中南传媒	118,741	2,720,356.31	0.06
459	002237	恒邦股份	226,472	2,710,869.84	0.06
460	300065	海兰信	84,277	2,690,964.61	0.06
461	000027	深圳能源	217,763	2,689,373.05	0.06
462	000919	金陵药业	137,800	2,684,344.00	0.06
463	002430	杭氧股份	200,300	2,647,966.00	0.06
464	300104	乐视网	51,100	2,644,936.00	0.06
465	000043	中航地产	172,578	2,640,443.40	0.06
466	002480	新筑股份	162,200	2,637,372.00	0.06
467	000540	中天城投	204,400	2,575,440.00	0.05
468	002472	双环传动	79,400	2,560,650.00	0.05
469	000902	新洋丰	94,200	2,557,530.00	0.05
470	600522	中天科技	112,311	2,552,829.03	0.05
471	000880	潍柴重机	117,636	2,535,055.80	0.05
472	300215	电科院	161,500	2,522,630.00	0.05
473	002342	巨力索具	264,600	2,505,762.00	0.05
474	300039	上海凯宝	159,510	2,480,380.50	0.05
475	600106	重庆路桥	213,200	2,477,384.00	0.05
476	300070	碧水源	50,420	2,459,991.80	0.05
477	600223	鲁商置业	229,700	2,444,008.00	0.05
478	002042	华孚色纺	178,154	2,426,457.48	0.05

479	002193	山东如意	101,210	2,408,798.00	0.05
480	002566	益盛药业	105,700	2,402,561.00	0.05
481	600879	航天电子	97,982	2,400,559.00	0.05
482	600502	安徽水利	119,800	2,394,802.00	0.05
483	600112	天成控股	125,800	2,390,200.00	0.05
484	002039	黔源电力	115,123	2,380,743.64	0.05
485	000858	五粮液	74,900	2,374,330.00	0.05
486	002081	金螳螂	83,786	2,361,927.34	0.05
487	002258	利尔化学	81,700	2,361,130.00	0.05
488	601588	北辰实业	306,300	2,358,510.00	0.05
489	600995	文山电力	169,600	2,355,744.00	0.05
490	002627	宜昌交运	80,215	2,344,684.45	0.05
491	600850	华东电脑	42,312	2,343,661.68	0.05
492	002585	双星新材	138,640	2,329,152.00	0.05
493	002133	广宇集团	230,040	2,316,502.80	0.05
494	600322	天房发展	280,927	2,312,029.21	0.05
495	002486	嘉麟杰	280,700	2,304,547.00	0.05
496	300117	嘉寓股份	210,200	2,303,792.00	0.05
497	002060	粤水电	184,200	2,287,764.00	0.05
498	600067	冠城大通	228,003	2,261,789.76	0.05
499	002409	雅克科技	76,100	2,260,170.00	0.05
500	601168	西部矿业	206,300	2,252,796.00	0.05
501	002670	华声股份	123,039	2,251,613.70	0.05
502	600370	三房巷	158,700	2,250,366.00	0.05
503	600054	黄山旅游	100,900	2,243,007.00	0.05
504	002351	漫步者	62,800	2,240,704.00	0.05
505	002701	奥瑞金	85,900	2,235,977.00	0.05
506	002099	海翔药业	85,900	2,235,118.00	0.05
507	600023	浙能电力	224,737	2,229,391.04	0.05
508	300168	万达信息	45,294	2,224,841.28	0.05
509	000553	沙隆达 A	139,074	2,215,448.82	0.05
510	002648	卫星石化	145,400	2,201,356.00	0.05
511	002101	广东鸿图	72,099	2,171,621.88	0.05
512	600096	云天化	140,601	2,170,879.44	0.05
513	000599	青岛双星	166,600	2,167,466.00	0.05
514	002628	成都路桥	285,000	2,163,150.00	0.05
515	603366	日出东方	146,700	2,156,490.00	0.05
516	000011	深物业 A	144,200	2,148,580.00	0.05
517	600082	海泰发展	234,800	2,146,072.00	0.05
518	600483	福能股份	120,913	2,144,996.62	0.05
519	002205	国统股份	77,601	2,124,715.38	0.04
520	600284	浦东建设	129,624	2,114,167.44	0.04
521	000498	山东路桥	230,300	2,114,154.00	0.04
522	300096	易联众	53,100	2,100,105.00	0.04

523	002457	青龙管业	133,300	2,091,477.00	0.04
524	002516	江苏旷达	150,950	2,087,638.50	0.04
525	600064	南京高科	106,858	2,083,731.00	0.04
526	600009	上海机场	65,700	2,082,690.00	0.04
527	000521	美菱电器	230,800	2,081,816.00	0.04
528	000036	华联控股	261,500	2,078,925.00	0.04
529	000417	合肥百货	168,983	2,070,041.75	0.04
530	300195	长荣股份	64,500	2,061,420.00	0.04
531	000888	峨眉山 A	137,980	2,060,041.40	0.04
532	002668	奥马电器	70,574	2,049,468.96	0.04
533	600982	宁波热电	221,657	2,048,110.68	0.04
534	002406	远东传动	178,700	2,046,115.00	0.04
535	600637	百视通	48,619	2,045,887.52	0.04
536	000422	湖北宜化	221,362	2,043,171.26	0.04
537	603167	渤海轮渡	122,711	2,040,683.93	0.04
538	603123	翠微股份	148,201	2,015,533.60	0.04
539	000421	南京中北	178,050	2,004,843.00	0.04
540	300133	华策影视	74,201	2,003,427.00	0.04
541	600249	两面针	180,670	2,001,823.60	0.04
542	600200	江苏吴中	54,454	2,001,184.50	0.04
543	000935	四川双马	218,213	1,996,648.95	0.04
544	002695	煌上煌	46,100	1,994,286.00	0.04
545	300103	达刚路机	80,700	1,988,448.00	0.04
546	600203	福日电子	125,700	1,986,060.00	0.04
547	002157	正邦科技	110,900	1,979,565.00	0.04
548	002687	乔治白	145,329	1,976,474.40	0.04
549	000619	海螺型材	137,785	1,970,325.50	0.04
550	600979	广安爱众	219,303	1,964,954.88	0.04
551	600256	广汇能源	188,866	1,964,206.40	0.04
552	000839	中信国安	83,100	1,958,667.00	0.04
553	600295	鄂尔多斯	162,015	1,944,180.00	0.04
554	601929	吉视传媒	128,482	1,942,647.84	0.04
555	000002	万科 A	133,382	1,936,706.64	0.04
556	002452	长高集团	186,336	1,936,031.04	0.04
557	600480	凌云股份	82,100	1,934,276.00	0.04
558	002328	新朋股份	137,801	1,929,214.00	0.04
559	000931	中关村	136,800	1,923,408.00	0.04
560	601169	北京银行	144,200	1,920,744.00	0.04
561	300225	金力泰	207,860	1,920,626.40	0.04
562	002033	丽江旅游	123,773	1,913,530.58	0.04
563	002391	长青股份	95,450	1,905,182.00	0.04
564	002088	鲁阳股份	113,101	1,887,655.69	0.04
565	000970	中科三环	91,290	1,881,486.90	0.04
566	002381	双箭股份	121,613	1,874,056.33	0.04

567	000546	金圆股份	160,100	1,873,170.00	0.04
568	000725	京东方 A	360,832	1,872,718.08	0.04
569	000009	中国宝安	114,285	1,863,988.35	0.04
570	002352	鼎泰新材	47,600	1,851,640.00	0.04
571	000407	胜利股份	207,122	1,847,528.24	0.04
572	600969	郴电国际	90,700	1,845,745.00	0.04
573	002562	兄弟科技	93,751	1,837,519.60	0.04
574	002560	通达股份	70,401	1,834,650.06	0.04
575	002483	润邦股份	104,699	1,832,232.50	0.04
576	002578	闽发铝业	169,108	1,821,293.16	0.04
577	002478	常宝股份	110,960	1,818,634.40	0.04
578	600466	蓝光发展	136,400	1,815,484.00	0.04
579	000635	英力特	123,174	1,808,194.32	0.04
580	002386	天原集团	212,220	1,803,870.00	0.04
581	300226	上海钢联	22,100	1,790,100.00	0.04
582	600703	三安光电	57,106	1,787,417.80	0.04
583	002333	罗普斯金	90,600	1,785,726.00	0.04
584	600389	江山股份	57,100	1,783,804.00	0.04
585	600367	红星发展	129,923	1,782,543.56	0.04
586	002541	鸿路钢构	91,900	1,777,346.00	0.04
587	600114	东睦股份	98,583	1,770,550.68	0.04
588	000537	广宇发展	147,341	1,765,145.18	0.04
589	002610	爱康科技	126,758	1,761,936.20	0.04
590	603008	喜临门	93,400	1,759,656.00	0.04
591	002554	惠博普	121,500	1,745,955.00	0.04
592	002535	林州重机	127,500	1,744,200.00	0.04
593	300079	数码视讯	62,700	1,742,433.00	0.04
594	600970	中材国际	118,096	1,726,563.52	0.04
595	600198	大唐电信	48,500	1,718,840.00	0.04
596	002282	博深工具	116,050	1,717,540.00	0.04
597	600810	神马股份	156,400	1,717,272.00	0.04
598	002035	华帝股份	108,116	1,713,638.60	0.04
599	600168	武汉控股	123,834	1,710,147.54	0.04
600	600548	深高速	199,014	1,701,569.70	0.04
601	002698	博实股份	32,038	1,691,606.40	0.04
602	600507	方大特钢	187,100	1,691,384.00	0.04
603	600617	国新能源	92,480	1,689,609.60	0.04
604	300205	天喻信息	55,718	1,679,897.70	0.04
605	601908	京运通	80,015	1,678,714.70	0.04
606	002052	同洲电子	120,100	1,668,189.00	0.04
607	600101	明星电力	125,300	1,665,237.00	0.04
608	300253	卫宁软件	32,000	1,664,000.00	0.04
609	000823	超声电子	123,625	1,663,992.50	0.04
610	002026	山东威达	130,831	1,661,553.70	0.03

611	300080	新大新材	138,222	1,639,312.92	0.03
612	002497	雅化集团	198,150	1,622,848.50	0.03
613	300029	天龙光电	106,100	1,594,683.00	0.03
614	600019	宝钢股份	182,399	1,594,167.26	0.03
615	601099	太平洋	122,921	1,588,139.32	0.03
616	300058	蓝色光标	99,441	1,572,162.21	0.03
617	600098	广州发展	111,803	1,568,596.09	0.03
618	002208	合肥城建	88,500	1,539,015.00	0.03
619	600392	盛和资源	60,200	1,535,702.00	0.03
620	000869	张裕 A	31,252	1,524,785.08	0.03
621	300144	宋城演艺	26,750	1,515,655.00	0.03
622	300095	华伍股份	133,950	1,514,974.50	0.03
623	002024	苏宁云商	98,785	1,511,410.50	0.03
624	600578	京能电力	169,200	1,510,956.00	0.03
625	300033	同花顺	17,538	1,508,092.62	0.03
626	600027	华电国际	135,289	1,504,413.68	0.03
627	300139	福星晓程	73,610	1,494,283.00	0.03
628	600640	号百控股	51,500	1,487,320.00	0.03
629	300124	汇川技术	30,526	1,465,248.00	0.03
630	600406	国电南瑞	70,806	1,464,976.14	0.03
631	000885	同力水泥	86,916	1,460,188.80	0.03
632	002036	汉麻产业	67,960	1,440,072.40	0.03
633	002705	新宝股份	76,234	1,433,199.20	0.03
634	300002	神州泰岳	94,041	1,433,184.84	0.03
635	000762	西藏矿业	74,900	1,423,100.00	0.03
636	600316	洪都航空	41,131	1,422,309.98	0.03
637	600469	风神股份	77,653	1,403,966.24	0.03
638	300047	天源迪科	38,800	1,392,144.00	0.03
639	300305	裕兴股份	53,841	1,346,025.00	0.03
640	000563	陕国投 A	94,874	1,334,877.18	0.03
641	000831	五矿稀土	52,000	1,330,160.00	0.03
642	600519	贵州茅台	5,067	1,305,512.55	0.03
643	300003	乐普医疗	31,994	1,297,996.58	0.03
644	000693	华泽钴镍	63,000	1,295,910.00	0.03
645	002450	康得新	41,778	1,278,406.80	0.03
646	002570	贝因美	65,593	1,273,160.13	0.03
647	300273	和佳股份	42,630	1,269,947.70	0.03
648	601669	中国电建	111,625	1,265,827.50	0.03
649	600468	百利电气	54,200	1,263,402.00	0.03
650	000983	西山煤电	132,200	1,253,256.00	0.03
651	002216	三全食品	84,774	1,246,177.80	0.03
652	600121	郑州煤电	132,500	1,203,100.00	0.03
653	300178	腾邦国际	33,100	1,195,241.00	0.03
654	600759	洲际油气	77,131	1,178,561.68	0.02

655	300072	三聚环保	34,784	1,172,220.80	0.02
656	000709	河北钢铁	167,100	1,169,700.00	0.02
657	000333	美的集团	31,177	1,162,278.56	0.02
658	600252	中恒集团	50,173	1,153,979.00	0.02
659	300199	翰宇药业	35,100	1,134,783.00	0.02
660	600373	中文传媒	47,100	1,128,516.00	0.02
661	300267	尔康制药	32,800	1,118,152.00	0.02
662	600584	长电科技	58,258	1,113,310.38	0.02
663	600028	中国石化	152,631	1,077,574.86	0.02
664	601000	唐山港	77,700	1,063,713.00	0.02
665	300197	铁汉生态	29,400	1,059,282.00	0.02
666	300315	掌趣科技	77,660	1,052,293.00	0.02
667	300170	汉得信息	42,950	1,043,255.50	0.02
668	002230	科大讯飞	29,612	1,034,643.28	0.02
669	600435	北方导航	22,773	1,033,211.01	0.02
670	300147	香雪制药	33,114	1,019,911.20	0.02
671	300274	阳光电源	33,300	1,017,981.00	0.02
672	002194	武汉凡谷	47,953	1,010,849.24	0.02
673	300077	国民技术	23,700	1,008,198.00	0.02
674	300202	聚龙股份	24,700	997,880.00	0.02
675	601899	紫金矿业	193,900	992,768.00	0.02
676	300015	爱尔眼科	29,992	967,541.92	0.02
677	300251	光线传媒	38,850	967,365.00	0.02
678	600885	宏发股份	30,500	955,870.00	0.02
679	600398	海澜之家	52,436	950,664.68	0.02
680	300005	探路者	34,500	945,300.00	0.02
681	300216	千山药机	19,000	927,580.00	0.02
682	300244	迪安诊断	11,040	926,697.60	0.02
683	002161	远望谷	41,734	908,131.84	0.02
684	600089	特变电工	60,995	903,335.95	0.02
685	600867	通化东宝	40,190	881,366.70	0.02
686	300146	汤臣倍健	22,000	864,160.00	0.02
687	300056	三维丝	18,500	861,175.00	0.02
688	600125	铁龙物流	55,100	850,193.00	0.02
689	600811	东方集团	68,800	848,304.00	0.02
690	300212	易华录	14,100	845,154.00	0.02
691	600415	小商品城	54,200	828,176.00	0.02
692	300228	富瑞特装	8,850	804,553.50	0.02
693	002140	东华科技	35,600	796,016.00	0.02
694	600333	长春燃气	65,703	786,464.91	0.02
695	600410	华胜天成	16,100	770,224.00	0.02
696	300332	天壕节能	30,500	768,600.00	0.02
697	002558	世纪游轮	24,213	766,341.45	0.02
698	300115	长盈精密	22,700	756,137.00	0.02

699	600100	同方股份	35,243	739,750.57	0.02
700	600079	人福医药	19,400	718,770.00	0.02
701	300352	北信源	16,500	716,100.00	0.02
702	600702	沱牌舍得	27,100	707,581.00	0.01
703	600078	澄星股份	43,588	663,845.24	0.01
704	300182	捷成股份	12,800	659,200.00	0.01
705	601699	潞安环能	68,130	658,817.10	0.01
706	000937	冀中能源	80,830	648,256.60	0.01
707	600352	浙江龙盛	45,308	642,014.36	0.01
708	300011	鼎汉技术	18,100	641,102.00	0.01
709	300020	银江股份	23,213	638,357.50	0.01
710	601666	平煤股份	81,600	617,712.00	0.01
711	300157	恒泰艾普	40,500	598,995.00	0.01
712	300271	华宇软件	13,100	573,911.00	0.01
713	300054	鼎龙股份	21,600	572,616.00	0.01
714	300009	安科生物	21,263	571,762.07	0.01
715	300171	东富龙	20,300	570,227.00	0.01
716	002646	青青稞酒	19,400	566,092.00	0.01
717	600618	氯碱化工	41,100	558,138.00	0.01
718	000596	古井贡酒	11,400	532,152.00	0.01
719	300071	华谊嘉信	38,700	528,642.00	0.01
720	300034	钢研高纳	14,800	525,252.00	0.01
721	300075	数字政通	13,900	523,891.00	0.01
722	300207	欣旺达	21,300	515,886.00	0.01
723	300043	互动娱乐	34,300	514,843.00	0.01
724	600780	通宝能源	51,750	502,492.50	0.01
725	300122	智飞生物	17,300	499,105.00	0.01
726	300452	山河药辅	5,471	479,806.70	0.01
727	600864	哈投股份	29,600	479,520.00	0.01
728	300006	莱美药业	11,164	478,935.60	0.01
729	300134	大富科技	17,127	478,699.65	0.01
730	300137	先河环保	20,700	473,616.00	0.01
731	002271	东方雨虹	18,400	472,880.00	0.01
732	300183	东软载波	16,400	467,400.00	0.01
733	300291	华录百纳	12,300	464,448.00	0.01
734	300238	冠昊生物	11,100	452,547.00	0.01
735	600875	东方电气	21,400	438,058.00	0.01
736	300363	博腾股份	9,300	436,728.00	0.01
737	300045	华力创通	22,800	419,064.00	0.01
738	300014	亿纬锂能	15,700	416,050.00	0.01
739	300052	中青宝	12,800	408,320.00	0.01
740	300288	朗玛信息	6,900	403,857.00	0.01
741	300001	特锐德	19,240	395,766.80	0.01
742	002146	荣盛发展	31,000	387,500.00	0.01

743	000718	苏宁环球	26,815	386,940.45	0.01
744	000652	泰达股份	37,800	384,804.00	0.01
745	600010	包钢股份	72,964	378,683.16	0.01
746	300012	华测检测	12,200	375,760.00	0.01
747	300295	三六五网	3,240	373,863.60	0.01
748	300347	泰格医药	10,800	368,496.00	0.01
749	600997	开滦股份	40,952	353,006.24	0.01
750	600108	亚盛集团	33,900	351,204.00	0.01
751	300336	新文化	14,286	340,578.24	0.01
752	600737	中粮屯河	16,200	337,122.00	0.01
753	300177	中海达	17,100	334,989.00	0.01
754	600197	伊力特	21,027	326,969.85	0.01
755	601101	昊华能源	28,400	323,760.00	0.01
756	300355	蒙草抗旱	18,020	322,738.20	0.01
757	000400	许继电气	12,003	301,995.48	0.01
758	002242	九阳股份	15,200	295,640.00	0.01
759	000629	攀钢钒钛	55,100	295,336.00	0.01
760	600271	航天信息	4,500	291,195.00	0.01
761	002241	歌尔声学	8,100	290,790.00	0.01
762	601211	国泰君安	8,000	274,720.00	0.01
763	300010	立思辰	8,500	242,420.00	0.01
764	601985	中国核电	18,000	235,260.00	0.00
765	002385	大北农	17,350	234,572.00	0.00
766	300386	飞天诚信	1,600	229,568.00	0.00
767	000063	中兴通讯	9,396	223,718.76	0.00
768	601727	上海电气	14,900	222,457.00	0.00
769	300181	佐力药业	18,453	218,852.58	0.00
770	600309	万华化学	8,800	212,784.00	0.00
771	000061	农产品	9,800	199,920.00	0.00
772	601118	海南橡胶	20,000	195,600.00	0.00
773	002461	珠江啤酒	7,323	193,327.20	0.00
774	600050	中国联通	26,119	191,452.27	0.00
775	600525	长园集团	8,700	178,959.00	0.00
776	300129	泰胜风能	19,200	174,720.00	0.00
777	002129	中环股份	8,600	170,194.00	0.00
778	600748	上实发展	10,700	167,455.00	0.00
779	603369	今世缘	4,049	150,177.41	0.00
780	600158	中体产业	5,200	148,980.00	0.00
781	000099	中信海直	8,355	148,551.90	0.00
782	603678	火炬电子	1,000	107,880.00	0.00
783	002250	联化科技	4,500	100,800.00	0.00
784	600110	中科英华	6,500	89,245.00	0.00
785	600959	江苏有线	3,000	81,870.00	0.00
786	300418	昆仑万维	500	77,955.00	0.00

787	603885	吉祥航空	1,000	68,960.00	0.00
788	002603	以岭药业	2,800	56,448.00	0.00
789	300457	赢合科技	500	44,995.00	0.00
790	603969	银龙股份	2,000	40,880.00	0.00
791	603318	派思股份	400	33,148.00	0.00
792	300427	红相电力	500	32,320.00	0.00
793	601198	东兴证券	1,000	29,910.00	0.00
794	300434	金石东方	500	29,635.00	0.00
795	603116	红蜻蜓	1,000	28,040.00	0.00
796	603799	华友钴业	1,000	26,600.00	0.00
797	002756	永兴特钢	500	26,545.00	0.00
798	300405	科隆精化	500	25,495.00	0.00
799	603979	金诚信	1,000	24,750.00	0.00
800	300476	胜宏科技	500	23,800.00	0.00
801	002743	富煌钢构	500	22,880.00	0.00
802	300415	伊之密	500	21,925.00	0.00
803	002733	雄韬股份	750	20,235.00	0.00
804	601015	陕西黑猫	1,000	17,390.00	0.00
805	002732	燕塘乳业	500	16,725.00	0.00
806	603789	星光农机	400	16,004.00	0.00
807	300487	蓝晓科技	500	7,415.00	0.00
808	300281	金明精机	68	1,603.44	0.00
809	300158	振东制药	61	1,152.90	0.00
810	600303	曙光股份	52	463.84	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	002673	西部证券	156,320,569.10	1.93
2	601318	中国平安	115,289,246.24	1.42
3	600036	招商银行	92,918,512.49	1.14
4	000686	东北证券	90,699,374.46	1.12
5	601009	南京银行	88,327,169.70	1.09
6	002142	宁波银行	81,610,336.60	1.01
7	601169	北京银行	78,566,006.32	0.97
8	600252	中恒集团	71,906,415.06	0.89
9	000100	TCL 集团	68,915,884.53	0.85
10	000039	中集集团	64,540,748.66	0.80
11	600837	海通证券	63,655,014.81	0.78

12	600648	外高桥	60,708,924.00	0.75
13	601668	中国建筑	54,999,954.03	0.68
14	002410	广联达	54,971,329.24	0.68
15	601328	交通银行	51,262,896.71	0.63
16	600015	华夏银行	50,495,110.11	0.62
17	600066	宇通客车	49,885,180.90	0.61
18	601766	中国中车	49,820,778.67	0.61
19	601939	建设银行	47,686,409.20	0.59
20	300059	东方财富	47,309,385.10	0.58

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	002673	西部证券	270,807,696.41	3.34
2	601318	中国平安	246,031,101.81	3.03
3	600036	招商银行	121,648,969.51	1.50
4	601169	北京银行	119,403,606.29	1.47
5	600000	浦发银行	118,812,454.08	1.46
6	600252	中恒集团	116,234,643.34	1.43
7	600016	民生银行	113,302,152.18	1.40
8	600837	海通证券	97,661,580.33	1.20
9	601628	中国人寿	93,762,184.37	1.16
10	601166	兴业银行	89,400,314.22	1.10
11	600030	中信证券	83,047,264.68	1.02
12	002142	宁波银行	82,392,310.16	1.02
13	600886	国投电力	78,069,169.14	0.96
14	601006	大秦铁路	76,401,493.79	0.94
15	601009	南京银行	76,218,521.88	0.94
16	002595	豪迈科技	73,904,537.71	0.91
17	601668	中国建筑	73,497,067.93	0.91
18	601988	中国银行	69,799,067.14	0.86
19	600183	生益科技	66,567,357.78	0.82
20	601601	中国太保	64,845,768.48	0.80

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	14,142,298,370.07
卖出股票的收入（成交）总额	21,187,415,691.07

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 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。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,379,606.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	100,490.82
5	应收申购款	5,524,361.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,004,458.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	002292	奥飞动漫	35,569,215.66	0.75	重大事项
2	000778	新兴铸管	40,497,148.80	0.85	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 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
198,988	14,877.25	23,742,138.30	0.80%	2,936,651,670.77	99.20%

8.2 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	227,226.57	0.01%

8.3 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

9 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	214,655,660.81
减：本报告期基金总赎回份额	5,081,712,379.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,960,393,809.07

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司八届十二次董事会会议审议通过，并由中国证监会核准，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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，上海证监局向我司出具了《关于对光大保德信基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，责令我司进行为期 3 个月的整改，并对我司原督察长采取出具警示函措施的决定。对此我司高度重视，对公司内部控制和风险管理工作进行了全面梳理，彻底排查业务中存在的风险隐患，针对性的制定、实施整改措施，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力，目前公司已经完成相关整改工作并通过了上海证监局的现场检查验收。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1	311,667,201.41	0.88%	283,741.15	0.90%	-
宏源证券	1	327,740,871.00	0.93%	290,018.22	0.92%	-
中信建投	1	345,540,687.18	0.98%	314,579.74	0.99%	-

申银万国	1	354,429,432.05	1.00%	322,671.32	1.02%	-
平安证券	1	481,581,528.02	1.36%	426,151.44	1.35%	-
中信证券	1	562,930,001.93	1.60%	512,491.17	1.62%	-
广发证券	1	699,257,439.88	1.98%	618,773.34	1.95%	-
中投建银	1	736,104,287.88	2.09%	651,379.66	2.06%	-
中金公司	1	784,635,663.86	2.22%	714,331.18	2.26%	-
中银国际	1	801,067,025.33	2.27%	729,288.86	2.30%	-
国金证券	1	1,129,137,115.85	3.20%	999,174.57	3.16%	-
长江证券	1	1,179,213,655.88	3.34%	1,073,556.49	3.39%	-
海通证券	1	1,312,520,157.65	3.72%	1,161,451.16	3.67%	-
东方证券	1	1,362,672,116.97	3.86%	1,240,575.94	3.92%	-
高华证券	1	1,709,477,259.75	4.84%	1,556,307.27	4.92%	-
瑞银证券	1	1,777,476,253.46	5.04%	1,572,892.03	4.97%	-
安信证券	1	2,839,227,828.57	8.04%	2,584,829.58	8.16%	-
兴业证券	1	3,489,144,716.89	9.89%	3,176,515.54	10.03%	-
国信证券	1	3,815,352,748.23	10.81%	3,376,209.41	10.66%	-
光大证券	3	11,273,955,858.38	31.94%	10,053,404.19	31.76%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

注：（1）新增租用交易单元：

本报告期内本基金新增租用 3 交易单元：海通证券（399117）、国金证券（396172）、瑞银证券（399152）。

（2）停止租用：本基金报告期内未停止租用交易单元。

（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。

10.7.2 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。

10.8 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	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2015-04-01

	的公告		
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	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
14	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
15	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
16	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
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

11 影响投资者决策的其他重要信息

无

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

上海市延安东路 222 号外滩中心大厦 46 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇一五年八月二十八日