

**光大保德信量化核心证券投资基金**  
**2016 年半年度报告**  
**2016 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：二〇一六年八月二十七日

## 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 2016 年 8 月 26 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
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
<b>5 托管人报告</b> .....	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.....	13
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.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	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
<b>7 投资组合报告</b> .....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	60
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	61
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>61</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>62</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
10.4 基金投资策略的改变 .....	62
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	65
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>66</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## 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	2,519,075,833.18 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	021-80262888-605	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	zhangjianchun@cebbank.com
客户服务电话		4008-202-888	95595
传真		021-80262468	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
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558	北京市西城区太平桥大街25号

	号外滩金融中心1幢（北区3号楼）6层至10层	
邮政编码	200010	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	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 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（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-95,441,562.63
本期利润	-502,373,199.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1983
本期加权平均净值利润率	-15.85%
本期基金份额净值增长率	-13.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,766,968,807.72
期末可供分配基金份额利润	0.7014
期末基金资产净值	3,316,459,710.94
期末基金份额净值	1.3165
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	379.71%

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	5.01%	1.30%	-0.43%	0.88%	5.44%	0.42%
过去三个月	3.36%	1.45%	-1.75%	0.91%	5.11%	0.54%
过去六个月	-13.02%	2.23%	-13.84%	1.66%	0.82%	0.57%
过去一年	-16.68%	2.63%	-26.49%	2.07%	9.81%	0.56%
过去三年	78.29%	1.91%	37.74%	1.65%	40.55%	0.26%
自基金合同生效起至今	379.71%	1.80%	156.09%	1.65%	223.62%	0.15%

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 2016 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 2016 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 24 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资



资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈月度理财债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊尚一年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金和光大保德信风格轮动混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
田大伟	基金经理	2014-02-25	-	6 年	田大伟先生，CFA、博士，2005年毕业于上海财经大学金融学专业，获得经济学硕士学位，2010年毕业于上海财经大学、美国南加州大学(联合培养)金融工程专业，获得经济学博士学位。田大伟先生于 2010 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任金融工程师、策略分析师、首席策略分析师，2013 年 7 月至 2014 年 2 月兼任光大保德信大中华 3 号特定客户资产管理计划的投资经理。现任光大保德信量化核心证券投资基金基金经理，同时兼任首席策略分析师。
赵大年	基金经理	2016-04-26	-	9 年	赵大年先生，硕士，2007 年 6 月至 2007 年 10 月在申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理；2007 年 10 月至 2009 年 4 月在钧锋投资咨询有限公司任职投资经理；2009 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监（负责量化投资研究等），2014 年 8 月至今担任量化投资部总监。现任光大保德

					信风格轮动混合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。
--	--	--	--	--	---

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且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

#### 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 2016 年上半年，市场首先在 1 月份较快下行；2 月之后在经济数据，特别是流动性数据偏正面的情况下，市场止跌回暖；进入 3 月份后，市场上涨动力较之前更强。而在整个 2 季度，市场陷入了胶着中，在一个窄幅区间里震荡，似乎在寻找方向。在整个行情变化过程中，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-13.02%，业绩比较基准收益率为-13.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年下半年,我们认为经济从总量数据已经稳住,海外风险密集释放第一波的高峰已过。后续经济的继续稳住甚至回升仍然需要政策的维护。我们认为政策在“供给”和“需求”端都将发力,最大亮点是企业成本的下降。而促成企业成本下降的理由有:减税、融资成本下降、能源成本下降等。这些将成为支撑今年市场向上的最主要的力量。

就目前市场而言,当前经济下行压力仍在,且英国脱欧、出口需求持续疲弱不振,稳增长任务较重,但同时受制于实体企业与金融双重去杠杆迫切形势,决定了货币政策逐步回归中性稳健,积极财政政策加大基建投资托底经济稳增长。此外,三季度国企改革、供给侧改革、G20 峰会与人民币正式纳入 SDR 前人民币汇率贬值压力有限,科技创新及十三五产业规划等产业政策或有望激发结构性机会。

另外,值得提及的是,中央政府对房地产行业的定位转变以及由此带来的调控政策思路的变化。我们仍为市场并没有对上述转变产生较一致的预期。我们判断房地产对经济的支撑作用仍会持续,并在边际上有所增强。同时,中央政府对钢铁等行业中的过剩落后产能的去化将会更加坚决和有效。我们认为这些变化会增强市场对中国经济平稳发展的信心,并为市场提供底部支撑。本基金会密切关注上述这些适时进行操作。

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,为基金份额持有者服务。

#### 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。

#### **4.7 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 2016 年 4 月 19 日进行了利润分配，分配方案为每份基金份额派发红利 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 2016 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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	391,917,661.39	243,970,919.27
结算备付金		4,007,007.85	4,184,280.01
存出保证金		417,406.11	1,938,607.86
交易性金融资产	6.4.7.2	2,932,284,880.35	3,641,193,892.96
其中：股票投资		2,932,284,880.35	3,641,193,892.96
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	73,371.18	60,269.77
应收股利		-	-
应收申购款		517,308.96	380,134.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,329,217,635.84</b>	<b>3,891,728,104.65</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		5,647,422.69	7,921,053.22
应付管理人报酬		3,961,387.91	4,976,952.14
应付托管费		660,231.34	829,492.04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,276,841.53	1,948,777.23
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	212,041.43	403,293.68
<b>负债合计</b>		<b>12,757,924.90</b>	<b>16,079,568.31</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	921,827,477.87	922,958,782.17
未分配利润	6.4.7.10	2,394,632,233.07	2,952,689,754.17
<b>所有者权益合计</b>		<b>3,316,459,710.94</b>	<b>3,875,648,536.34</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>3,329,217,635.84</b>	<b>3,891,728,104.65</b>

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3165 元，基金份额总额 2,519,075,833.18 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2016年1月1日至 2016年6月30日	2015年1月1日至 2015年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>-463,597,320.84</b>	<b>4,022,920,180.11</b>
1.利息收入		1,520,789.43	2,554,246.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,520,789.43	2,554,246.27
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）		-58,256,466.04	4,117,630,611.30
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-74,023,589.46	4,091,750,234.62
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	15,767,123.42	25,880,376.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-406,931,637.33	-97,972,797.82
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	69,993.10	708,120.36
<b>减：二、费用</b>		<b>38,775,879.12</b>	<b>123,370,562.36</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	23,659,529.36	56,820,966.29
2. 托管费	6.4.10.2	3,943,254.95	9,470,161.06
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	10,974,190.65	56,881,080.73
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	198,904.16	198,354.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-502,373,199.96</b>	<b>3,899,549,617.75</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-502,373,199.96</b>	<b>3,899,549,617.75</b>

### 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：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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	922,958,782.17	2,952,689,754.17	3,875,648,536.34

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-502,373,199.96	-502,373,199.96
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)	-1,131,304.30	-5,291,351.42	-6,422,655.72
其中: 1.基金申购款	38,498,340.10	93,252,764.21	131,751,104.31
2.基金赎回款	-39,629,644.40	-98,544,115.63	-138,173,760.03
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)	-	-50,392,969.72	-50,392,969.72
五、期末所有者权益(基金净值)	921,827,477.87	2,394,632,233.07	3,316,459,710.94
项目	上年度可比期间 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

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：林昌，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。

#### 6.4.2 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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年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

本基金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。

## 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 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 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。

## 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；

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

#### 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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	391,917,661.39
定期存款	-
其他存款	-
合计	391,917,661.39

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,863,365,789.96	2,932,284,880.35	68,919,090.39
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		2,863,365,789.96	2,932,284,880.35	68,919,090.39

### 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

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	71,534.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,622.79
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	44.85
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	169.11
合计	73,371.18

### 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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	2,276,841.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,276,841.53

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,137.27
其他	-
预提费用	198,904.16
合计	212,041.43

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,522,166,950.02	922,958,782.17
本期申购	105,204,726.49	38,498,340.10
本期赎回（以“-”号填列）	-108,295,843.33	-39,629,644.40
本期末	2,519,075,833.18	921,827,477.87

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	1,913,996,849.88	1,038,692,904.29	2,952,689,754.17
本期利润	-95,441,562.63	-406,931,637.33	-502,373,199.96
本期基金份额交易产生的变动数	-1,193,509.81	-4,097,841.61	-5,291,351.42
其中：基金申购款	76,723,343.50	16,529,420.71	93,252,764.21
基金赎回款	-77,916,853.31	-20,627,262.32	-98,544,115.63
本期已分配利润	-50,392,969.72	-	-50,392,969.72
本期末	1,766,968,807.72	627,663,425.35	2,394,632,233.07

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,468,923.48
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	45,582.52
其他	6,283.43
合计	1,520,789.43

### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,716,396,981.70
减：卖出股票成本总额	3,790,420,571.16
买卖股票差价收入	-74,023,589.46

### 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
	2016年1月1日至2016年6月30日

股票投资产生的股利收益	15,767,123.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,767,123.42

#### 6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1.交易性金融资产	-406,931,637.33
——股票投资	-406,931,637.33
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-406,931,637.33

#### 6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	67,756.60
转换费收入	2,236.50
合计	69,993.10

#### 6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	10,974,190.65
银行间市场交易费用	-
合计	10,974,190.65

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	149,178.12

合计	198,904.16
----	------------

#### 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

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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	454,186,600.87	6.31%	11,273,955,858.38	31.94%

##### 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 2016年1月1日至2016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	413,900.82	6.25%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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 2016年1月1日至2016年6月 30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	23,659,529.36
其中：支付销售机构的客户维护费	4,762,040.38	11,715,898.65

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,943,254.95	9,470,161.06

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

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。

#### 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	391,917,661.39	1,468,923.48	455,648,414.21	2,305,581.84

#### 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					
-	2016-04-19	-	2016-04-19	0.200	25,678,368.67	24,714,601.05	50,392,969.72	-
合计				0.200	25,678,368.67	24,714,601.05	50,392,969.72	-

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股未上市	12.98	12.98	15,341.00	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股未上市	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股未上市	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股未上市	10.05	10.05	926.00	9,306.30	9,306.30	-

6.4.12.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

000159	国际实业	2016-02-23	重大事项	7.63	2016-08-03	7.20	532,700.00	5,092,407.92	4,064,501.00	-
000407	胜利股份	2016-05-23	重大事项	6.73	-	-	580,011.00	3,272,512.74	3,903,474.03	-
000415	渤海金控	2016-02-01	重大事项	6.82	2016-08-11	7.50	236,600.00	1,765,758.62	1,613,612.00	-
000498	山东路桥	2016-06-20	重大事项	5.76	2016-07-04	6.00	216,900.00	1,264,530.80	1,249,344.00	-
000505	*ST 珠江	2016-05-03	重大事项	9.84	-	-	144,900.00	1,164,996.00	1,425,816.00	-
000524	岭南控股	2016-04-05	重大事项	13.08	-	-	382,939.00	5,916,668.37	5,008,842.12	-
000537	广宇发展	2016-04-13	重大事项	8.01	2016-07-20	8.81	152,900.00	1,103,222.00	1,224,729.00	-
000546	金圆股份	2016-06-16	重大事项	10.54	2016-07-12	10.95	147,200.00	1,365,115.00	1,551,488.00	-
000551	创元科技	2016-06-07	重大事项	9.18	2016-07-07	10.10	422,816.00	4,537,488.20	3,881,450.88	-
000553	沙隆达 A	2015-08-05	重大事项	10.68	-	-	23,874.00	353,151.10	254,974.32	-
000608	阳光股份	2016-03-08	重大事项	5.30	2016-07-14	5.12	662,868.00	3,702,277.02	3,513,200.40	-
000619	海螺型材	2016-05-16	重大事项	11.35	2016-07-13	11.50	605,091.00	6,376,926.02	6,867,782.85	-
000639	西王食品	2016-05-27	重大事项	14.12	-	-	349,063.00	4,348,543.15	4,928,769.56	-
000693	ST 华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	-	-	216,525.00	3,229,858.25	2,706,562.50	-
000728	国元证券	2016-06-08	重大事项	16.72	2016-07-08	17.37	686,131.00	11,032,061.55	11,472,110.32	-
000818	方大化工	2016-02-15	重大事项	6.57	2016-08-23	7.23	451,119.00	3,333,016.42	2,963,851.83	-
000893	东凌国际	2016-01-15	重大事项	12.58	2016-07-12	12.00	241,400.00	3,175,411.00	3,036,812.00	-
000916	华北高速	2016-06-24	重大事项	5.01	-	-	1,562,500.00	8,475,056.54	7,828,125.00	-
000950	*ST 建峰	2016-03-18	重大事项	7.45	-	-	180,000.00	1,102,162.36	1,341,000.00	-
002012	凯恩股份	2016-01-19	重大事项	8.71	2016-07-18	8.80	415,700.00	3,124,193.52	3,620,747.00	-
002046	轴研科技	2016-05-09	重大事项	10.33	2016-08-22	11.36	118,848.00	1,116,028.72	1,227,699.84	-
002052	同洲电子	2016-01-12	重大事项	10.03	-	-	50,100.00	820,713.77	502,503.00	-

002057	中钢天源	2016-06-13	重大事项	15.05	-	-	311,700.00	4,343,001.00	4,691,085.00	-
002059	云南旅游	2016-06-01	重大事项	8.56	-	-	154,800.00	1,401,090.08	1,325,088.00	-
002101	广东鸿图	2016-05-03	重大事项	21.62	-	-	159,120.00	2,866,490.20	3,440,174.40	-
002274	华昌化工	2016-06-09	重大事项	10.50	2016-07-07	10.65	261,600.00	2,448,582.98	2,746,800.00	-
002314	南山控股	2016-03-07	重大事项	6.83	2016-07-19	7.51	578,000.00	4,223,980.72	3,947,740.00	-
002469	三维工程	2016-05-10	重大事项	9.01	2016-08-02	8.11	605,223.00	6,271,825.36	5,453,059.23	-
002567	唐人神	2016-05-16	重大事项	13.98	2016-07-29	13.23	349,300.00	3,652,638.03	4,883,214.00	-
002574	明牌珠宝	2016-06-27	重大事项	13.04	-	-	275,200.00	3,181,087.03	3,588,608.00	-
002576	通达动力	2016-06-14	重大事项	18.83	-	-	62,800.00	1,187,598.97	1,182,524.00	-
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事项	14.45	2016-07-28	14.00	278,850.00	3,084,450.25	4,029,382.50	-
002611	东方精工	2016-03-29	重大事项	10.84	2016-08-18	11.92	331,642.00	3,345,660.34	3,594,999.28	-
002630	华西能源	2016-04-25	重大事项	11.06	-	-	574,733.00	5,772,057.09	6,356,546.98	-
002632	道明光学	2016-06-22	重大事项	11.98	-	-	125,400.00	1,482,866.00	1,502,292.00	-
002682	龙洲股份	2016-04-06	重大事项	12.69	2016-07-20	13.96	102,454.00	1,116,200.75	1,300,141.26	-
002686	亿利达	2016-04-20	重大事项	13.54	2016-07-14	14.89	295,200.00	3,522,636.00	3,997,008.00	-
300032	金龙机电	2016-06-28	重大事项	20.10	2016-07-07	19.80	25,600.00	432,341.79	514,560.00	-
300035	中科电气	2016-05-23	重大事项	13.76	-	-	290,000.00	2,717,973.78	3,990,400.00	-
300044	赛为智能	2016-05-12	重大事项	12.97	-	-	280,050.00	3,508,075.69	3,632,248.50	-
300052	中青宝	2016-06-08	重大事项	22.03	-	-	64,700.00	1,394,575.03	1,425,341.00	-
300061	康耐特	2016-05-05	重大事项	28.84	2016-07-21	31.56	19,900.00	355,511.60	573,916.00	-
300080	易成新能	2016-05-19	重大事项	7.76	-	-	933,235.00	7,858,766.07	7,241,903.60	-
300110	华仁药业	2016-01-27	重大事项	9.53	2016-07-12	10.48	820,300.00	9,590,196.16	7,817,459.00	-

300125	易世达	2016-03-28	重大事项	24.81	2016-08-08	24.22	51,600.00	1,137,698.00	1,280,196.00	-
300163	先锋新材	2016-03-17	重大事项	11.95	-	-	557,473.00	5,331,901.43	6,661,802.35	-
300166	东方国信	2016-06-08	重大事项	27.47	-	-	29,300.00	698,053.34	804,871.00	-
300176	鸿特精密	2016-04-27	重大事项	30.20	-	-	237,017.00	5,579,510.77	7,157,913.40	-
300180	华峰超纤	2016-04-06	重大事项	17.09	-	-	305,033.00	4,297,446.56	5,213,013.97	-
300184	力源信息	2016-03-04	重大事项	11.03	-	-	363,536.00	4,597,366.99	4,009,802.08	-
300225	金力泰	2016-03-22	重大事项	7.12	2016-07-08	7.58	561,106.00	3,576,405.88	3,995,074.72	-
300242	明家联合	2016-05-09	重大事项	34.99	2016-08-12	36.69	41,358.00	1,026,940.43	1,447,116.42	-
300265	通光线缆	2016-03-24	重大事项	12.38	2016-07-21	12.55	319,772.00	4,282,402.20	3,958,777.36	-
300299	富春通信	2016-02-29	重大事项	27.51	-	-	17,600.00	562,329.67	484,176.00	-
300300	汉鼎宇佑	2016-05-10	重大事项	30.56	-	-	35,300.00	738,007.95	1,078,768.00	-
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项	8.99	-	-	833,800.00	5,433,467.75	7,495,862.00	-
300334	津膜科技	2016-05-20	重大事项	18.05	-	-	176,537.00	2,961,670.54	3,186,492.85	-
300345	红宇新材	2016-06-21	重大事项	10.46	2016-07-19	11.46	90,400.00	971,559.10	945,584.00	-
300355	蒙草生态	2016-06-30	重大事项	7.11	2016-07-06	7.38	167,100.00	1,178,595.00	1,188,081.00	-
300356	光一科技	2016-05-26	重大事项	48.44	2016-08-10	44.27	105,807.00	3,437,530.21	5,125,291.08	-
300385	雪浪环境	2016-06-21	重大事项	35.67	2016-07-05	37.38	27,600.00	851,322.00	984,492.00	-
300413	快乐购	2016-06-20	重大事项	24.35	-	-	16,800.00	456,717.64	409,080.00	-
300427	红相电力	2016-06-09	重大事项	21.89	-	-	1,600.00	5,230.00	35,024.00	-
300434	金石东方	2016-04-15	重大事项	29.66	-	-	1,000.00	5,285.00	29,660.00	-
300503	昊志机电	2016-06-30	重大事项	84.72	2016-07-05	82.99	1,863.00	14,382.36	157,833.36	-
300508	维宏股份	2016-06-30	重大事项	254.50	2016-07-06	242.00	970.00	19,477.60	246,865.00	-

600019	宝钢股份	2016-06-27	重大事项	4.90	-	-	128,800.00	675,697.00	631,120.00	-
600121	郑州煤电	2016-06-17	重大事项	4.80	2016-07-01	5.05	298,700.00	1,523,829.16	1,433,760.00	-
600166	福田汽车	2016-06-30	重大事项	5.52	2016-07-01	5.62	1,754,100.00	9,603,784.31	9,682,632.00	-
600203	福日电子	2016-06-30	重大事项	13.80	2016-07-01	13.25	120,300.00	1,158,486.18	1,660,140.00	-
600237	铜峰电子	2016-06-30	重大事项	7.61	2016-07-07	7.42	435,000.00	3,187,437.51	3,310,350.00	-
600295	鄂尔多斯	2016-06-30	重大事项	7.89	2016-07-14	8.46	152,000.00	1,185,418.00	1,199,280.00	-
600330	天通股份	2016-05-23	重大事项	13.93	-	-	322,355.00	3,303,773.35	4,490,405.15	-
600408	安泰集团	2016-04-14	重大事项	5.88	-	-	68.00	246.69	399.84	-
600475	华光股份	2016-05-18	重大事项	14.85	-	-	78,711.00	1,156,607.63	1,168,858.35	-
600614	鼎立股份	2016-04-26	重大事项	8.14	-	-	974,702.00	6,971,800.67	7,934,074.28	-
600640	号百控股	2016-04-18	重大事项	16.79	2016-08-22	18.44	87,800.00	1,508,104.83	1,474,162.00	-
601900	南方传媒	2016-06-06	重大事项	17.67	-	-	18,362.00	112,559.06	324,456.54	-
603611	诺力股份	2016-03-30	重大事项	25.37	2016-07-19	27.91	49,300.00	1,126,916.60	1,250,741.00	-
603919	金徽酒	2016-06-06	重大事项	30.90	2016-07-05	33.99	6,604.00	72,247.76	204,063.60	-
002387	黑牛食品	2016-05-25	重大事项	18.36	2016-08-03	17.55	130,500.00	2,219,483.55	2,395,980.00	-
300284	苏交科	2016-05-20	重大事项	23.61	2016-08-10	21.44	101,507.00	1,853,740.03	2,396,580.27	-
300402	宝色股份	2016-05-31	重大事项	16.48	-	-	73,401.00	1,176,656.10	1,209,648.48	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 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 2016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	391,917,661.39	-	-	-	-	-	391,917,661.39

结算备付金	4,007,007.85	-	-	-	-	-	4,007,007.85
存出保证金	417,406.11	-	-	-	-	-	417,406.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,932,284,880.35	2,932,284,880.35
应收利息	-	-	-	-	-	73,371.18	73,371.18
应收申购款	-	-	-	-	-	517,308.96	517,308.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	396,342,075.35	0.00	0.00	0.00	0.00	2,932,875,560.49	3,329,217,635.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,647,422.69	5,647,422.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,961,387.91	3,961,387.91
应付托管费	-	-	-	-	-	660,231.34	660,231.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,276,841.53	2,276,841.53
其他负债	-	-	-	-	-	212,041.43	212,041.43
负债总计	-	-	-	-	-	12,757,924.90	12,757,924.90
利率敏感度缺口	396,342,075.35	0.00	0.00	0.00	0.00	2,920,117,635.59	3,316,459,710.94
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	243,970,919.27	-	-	-	-	-	243,970,919.27
结算备付金	4,184,280.01	-	-	-	-	-	4,184,280.01
存出保证金	1,938,607.86	-	-	-	-	-	1,938,607.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,641,193,892.96	3,641,193,892.96
应收利息	-	-	-	-	-	60,269.77	60,269.77

应收申购款	-	-	-	-	-	380,134.78	380,134.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	250,093,807.14	0.00	0.00	0.00	0.00	3,641,634,297.51	3,891,728,104.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,921,053.22	7,921,053.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,976,952.14	4,976,952.14
应付托管费	-	-	-	-	-	829,492.04	829,492.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,948,777.23	1,948,777.23
其他负债	-	-	-	-	-	403,293.68	403,293.68
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	16,079,568.31	16,079,568.31
利率敏感度缺口	250,093,807.14	0.00	0.00	0.00	0.00	3,625,554,729.20	3,875,648,536.34

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 2016年6月30日		上年度末 2015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	2,932,284,880. 35	88.42	3,641,193,892 .96	93.95
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	2,932,284,880. 35	88.42	3,641,193,892 .96	93.95

#### 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 4,212	增加约 3,925
	业绩比较基准下降 1%	减少约 4,212	减少约 3,925

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	2,932,284,880.35	88.08
	其中：股票	2,932,284,880.35	88.08
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	395,924,669.24	11.89
7	其他各项资产	1,008,086.25	0.03
8	合计	3,329,217,635.84	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	35,424,627.75	1.07
B	采矿业	46,378,535.57	1.40
C	制造业	1,847,672,554.73	55.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	120,318,077.03	3.63
E	建筑业	56,039,284.28	1.69
F	批发和零售业	184,213,833.40	5.55
G	交通运输、仓储和邮政业	71,397,872.83	2.15
H	住宿和餐饮业	11,560,921.72	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,889,509.34	3.89

J	金融业	113,697,097.30	3.43
K	房地产业	195,954,499.03	5.91
L	租赁和商务服务业	19,901,806.44	0.60
M	科学研究和技术服务业	25,604,829.83	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	15,726,692.49	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	315,518.64	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	38,176,331.33	1.15
S	综合	21,012,888.64	0.63
	合计	2,932,284,880.35	88.42

### 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	601318	中国平安	1,434,500	45,961,380.00	1.39
2	002566	益盛药业	1,594,053	20,770,510.59	0.63
3	600657	信达地产	3,639,915	18,126,776.70	0.55
4	601137	博威合金	963,974	12,926,891.34	0.39
5	002315	焦点科技	186,298	12,567,663.08	0.38
6	600017	日照港	3,060,149	12,393,603.45	0.37
7	600238	海南椰岛	978,904	11,697,902.80	0.35
8	300139	晓程科技	785,770	11,558,676.70	0.35
9	000728	国元证券	686,131	11,472,110.32	0.35
10	000666	经纬纺机	586,877	11,444,101.50	0.35
11	603366	日出东方	1,335,268	11,216,251.20	0.34
12	600382	广东明珠	696,300	11,140,800.00	0.34
13	002383	合众思壮	292,650	10,485,649.50	0.32
14	601398	工商银行	2,342,400	10,400,256.00	0.31
15	601288	农业银行	3,208,800	10,268,160.00	0.31
16	600582	天地科技	2,239,300	10,076,850.00	0.30
17	300082	奥克股份	1,269,389	9,888,540.31	0.30
18	601628	中国人寿	472,800	9,843,696.00	0.30
19	601988	中国银行	3,064,700	9,837,687.00	0.30
20	600166	福田汽车	1,754,100	9,682,632.00	0.29
21	002351	漫步者	728,574	9,442,319.04	0.28
22	600642	申能股份	1,606,697	9,222,440.78	0.28
23	002203	海亮股份	1,166,739	9,065,562.03	0.27

24	300154	瑞凌股份	866,390	8,949,808.70	0.27
25	000043	中航地产	1,071,660	8,841,195.00	0.27
26	000926	福星股份	746,567	8,757,230.91	0.26
27	000725	京东方 A	3,777,232	8,725,405.92	0.26
28	600325	华发股份	776,572	8,596,652.04	0.26
29	300090	盛运环保	1,061,635	8,588,627.15	0.26
30	601328	交通银行	1,496,800	8,426,984.00	0.25
31	000903	云内动力	1,047,827	8,414,050.81	0.25
32	600239	云南城投	1,810,218	8,399,411.52	0.25
33	300103	达刚路机	448,600	8,388,820.00	0.25
34	600533	栖霞建设	1,661,636	8,374,645.44	0.25
35	600223	鲁商置业	1,639,102	8,359,420.20	0.25
36	002537	海立美达	273,822	8,324,188.80	0.25
37	000701	厦门信达	470,615	8,296,942.45	0.25
38	600765	中航重机	568,707	8,291,748.06	0.25
39	600510	黑牡丹	950,781	8,290,810.32	0.25
40	300194	福安药业	382,064	8,271,685.60	0.25
41	300214	日科化学	1,067,700	8,221,290.00	0.25
42	002350	北京科锐	398,858	8,056,931.60	0.24
43	600858	银座股份	981,262	8,036,535.78	0.24
44	600108	亚盛集团	1,573,700	7,947,185.00	0.24
45	600614	鼎立股份	974,702	7,934,074.28	0.24
46	002062	宏润建设	1,329,341	7,869,698.72	0.24
47	000823	超声电子	783,508	7,835,080.00	0.24
48	000916	华北高速	1,562,500	7,828,125.00	0.24
49	300110	华仁药业	820,300	7,817,459.00	0.24
50	601126	四方股份	741,886	7,812,059.58	0.24
51	002541	鸿路钢构	452,507	7,796,695.61	0.24
52	002187	广百股份	632,650	7,794,248.00	0.24
53	600062	华润双鹤	427,536	7,789,705.92	0.23
54	600327	大东方	873,008	7,787,231.36	0.23
55	002582	好想你	196,700	7,773,584.00	0.23
56	600105	永鼎股份	823,800	7,719,006.00	0.23
57	002433	太安堂	770,137	7,716,772.74	0.23
58	002540	亚太科技	882,600	7,696,272.00	0.23
59	000601	韶能股份	733,331	7,663,308.95	0.23
60	002398	建研集团	583,204	7,663,300.56	0.23
61	603167	渤海轮渡	770,128	7,662,773.60	0.23
62	002083	孚日股份	1,212,550	7,639,065.00	0.23
63	000572	海马汽车	1,468,200	7,619,958.00	0.23
64	600780	通宝能源	1,503,107	7,545,597.14	0.23
65	300323	华灿光电	833,800	7,495,862.00	0.23
66	600064	南京高科	501,230	7,493,388.50	0.23
67	002449	国星光电	563,723	7,480,604.21	0.23

68	600805	悦达投资	853,432	7,407,789.76	0.22
69	000789	万年青	1,190,318	7,356,165.24	0.22
70	300341	麦迪电气	430,202	7,334,944.10	0.22
71	600290	华仪电气	748,050	7,308,448.50	0.22
72	600561	江西长运	595,930	7,282,264.60	0.22
73	002662	京威股份	480,372	7,258,420.92	0.22
74	000026	飞亚达 A	633,720	7,243,419.60	0.22
75	300080	易成新能	933,235	7,241,903.60	0.22
76	300165	天瑞仪器	666,200	7,214,946.00	0.22
77	300176	鸿特精密	237,017	7,157,913.40	0.22
78	601668	中国建筑	1,333,700	7,095,284.00	0.21
79	300371	汇中股份	197,147	7,093,349.06	0.21
80	000543	皖能电力	985,945	7,039,647.30	0.21
81	002406	远东传动	815,800	6,991,406.00	0.21
82	600410	华胜天成	620,630	6,963,468.60	0.21
83	600059	古越龙山	676,603	6,962,244.87	0.21
84	000708	大冶特钢	620,598	6,950,697.60	0.21
85	000530	大冷股份	651,894	6,949,190.04	0.21
86	000911	南宁糖业	274,407	6,882,127.56	0.21
87	600467	好当家	1,766,122	6,870,214.58	0.21
88	000619	海螺型材	605,091	6,867,782.85	0.21
89	002454	松芝股份	376,594	6,846,478.92	0.21
90	600499	科达洁能	404,188	6,834,819.08	0.21
91	002068	黑猫股份	875,689	6,830,374.20	0.21
92	002585	双星新材	642,380	6,822,075.60	0.21
93	600496	精工钢构	1,598,347	6,808,958.22	0.21
94	300320	海达股份	516,665	6,804,478.05	0.21
95	002565	上海绿新	917,231	6,796,681.71	0.20
96	002564	天沃科技	877,595	6,757,481.50	0.20
97	002578	闽发铝业	714,838	6,740,922.34	0.20
98	300221	银禧科技	326,700	6,671,214.00	0.20
99	600602	仪电电子	631,346	6,667,013.76	0.20
100	002538	司尔特	712,584	6,662,660.40	0.20
101	300163	先锋新材	557,473	6,661,802.35	0.20
102	601339	百隆东方	1,044,872	6,634,937.20	0.20
103	600761	安徽合力	657,491	6,634,084.19	0.20
104	300337	银邦股份	840,347	6,613,530.89	0.20
105	000090	天健集团	745,714	6,562,283.20	0.20
106	600470	六国化工	872,200	6,550,222.00	0.20
107	300258	精锻科技	403,767	6,524,874.72	0.20
108	601700	风范股份	879,997	6,415,178.13	0.19
109	002394	联发股份	422,279	6,376,412.90	0.19
110	600859	王府井	417,300	6,359,652.00	0.19
111	002630	华西能源	574,733	6,356,546.98	0.19



112	000404	华意压缩	656,167	6,312,326.54	0.19
113	000685	中山公用	602,818	6,257,250.84	0.19
114	300067	安诺其	744,049	6,242,571.11	0.19
115	002305	南国置业	1,109,600	6,235,952.00	0.19
116	300382	斯莱克	165,344	6,213,627.52	0.19
117	300386	飞天诚信	186,200	6,176,254.00	0.19
118	600880	博瑞传播	724,600	6,166,346.00	0.19
119	300210	森远股份	343,302	6,138,239.76	0.19
120	300050	世纪鼎利	425,700	6,125,823.00	0.18
121	002695	煌上煌	121,268	6,107,056.48	0.18
122	300062	中能电气	250,450	6,068,403.50	0.18
123	002339	积成电子	332,461	6,064,088.64	0.18
124	300049	福瑞股份	254,687	6,053,909.99	0.18
125	600458	时代新材	385,877	6,011,963.66	0.18
126	603100	川仪股份	374,901	5,983,419.96	0.18
127	000766	通化金马	298,502	5,981,980.08	0.18
128	300255	常山药业	717,440	5,954,752.00	0.18
129	300305	裕兴股份	429,120	5,947,603.20	0.18
130	002683	宏大爆破	725,075	5,945,615.00	0.18
131	600256	广汇能源	1,443,100	5,916,710.00	0.18
132	300346	南大光电	131,670	5,889,599.10	0.18
133	002211	宏达新材	492,507	5,841,133.02	0.18
134	300336	新文化	231,700	5,787,866.00	0.17
135	000828	东莞控股	634,052	5,757,192.16	0.17
136	300401	花园生物	210,087	5,714,366.40	0.17
137	002365	永安药业	313,261	5,704,482.81	0.17
138	002545	东方铁塔	638,450	5,694,974.00	0.17
139	600260	凯乐科技	347,000	5,676,920.00	0.17
140	600335	国机汽车	504,980	5,660,825.80	0.17
141	600153	建发股份	469,179	5,630,148.00	0.17
142	600595	中孚实业	996,050	5,617,722.00	0.17
143	600869	智慧能源	544,400	5,607,320.00	0.17
144	601965	中国汽研	579,850	5,572,358.50	0.17
145	300118	东方日升	294,948	5,562,719.28	0.17
146	600141	兴发集团	481,961	5,552,190.72	0.17
147	300041	回天新材	385,400	5,545,906.00	0.17
148	002448	中原内配	362,700	5,531,175.00	0.17
149	600987	航民股份	454,074	5,503,376.88	0.17
150	300373	扬杰科技	227,828	5,492,933.08	0.17
151	600219	南山铝业	740,800	5,481,920.00	0.17
152	300306	远方光电	230,776	5,476,314.48	0.17
153	600199	金种子酒	492,985	5,472,133.50	0.16
154	000612	焦作万方	765,300	5,464,242.00	0.16
155	000756	新华制药	508,509	5,456,301.57	0.16

156	002469	三维工程	605,223	5,453,059.23	0.16
157	000597	东北制药	611,800	5,432,784.00	0.16
158	603518	维格娜丝	183,691	5,424,395.23	0.16
159	300286	安科瑞	182,600	5,421,394.00	0.16
160	002042	华孚色纺	524,020	5,418,366.80	0.16
161	300259	新天科技	428,350	5,410,060.50	0.16
162	600396	金山股份	1,031,076	5,402,838.24	0.16
163	002553	南方轴承	382,789	5,393,497.01	0.16
164	002404	嘉欣丝绸	682,500	5,384,925.00	0.16
165	002302	西部建设	745,620	5,383,376.40	0.16
166	601179	中国西电	1,058,100	5,364,567.00	0.16
167	600529	山东药玻	304,526	5,362,702.86	0.16
168	600723	首商股份	596,100	5,323,173.00	0.16
169	000419	通程控股	729,369	5,309,806.32	0.16
170	002255	海陆重工	616,300	5,306,343.00	0.16
171	600051	宁波联合	513,911	5,283,005.08	0.16
172	600888	新疆众和	741,815	5,281,722.80	0.16
173	300068	南都电源	240,694	5,261,570.84	0.16
174	601588	北辰实业	1,225,000	5,230,750.00	0.16
175	600969	郴电国际	349,792	5,215,398.72	0.16
176	300180	华峰超纤	305,033	5,213,013.97	0.16
177	300084	海默科技	425,199	5,195,931.78	0.16
178	600322	天房发展	1,162,396	5,184,286.16	0.16
179	002403	爱仕达	320,910	5,182,696.50	0.16
180	002048	宁波华翔	225,886	5,166,012.82	0.16
181	300121	阳谷华泰	374,481	5,126,644.89	0.15
182	300356	光一科技	105,807	5,125,291.08	0.15
183	300275	梅安森	225,600	5,118,864.00	0.15
184	000042	中洲控股	298,996	5,118,811.52	0.15
185	300095	华伍股份	387,268	5,115,810.28	0.15
186	300105	龙源技术	607,900	5,112,439.00	0.15
187	002604	龙力生物	473,300	5,106,907.00	0.15
188	600114	东睦股份	303,500	5,101,835.00	0.15
189	601677	明泰铝业	381,258	5,085,981.72	0.15
190	600790	轻纺城	865,670	5,081,482.90	0.15
191	600686	金龙汽车	344,939	5,080,951.47	0.15
192	601222	林洋能源	121,376	5,079,585.60	0.15
193	000809	铁岭新城	1,161,600	5,076,192.00	0.15
194	600791	京能置业	725,830	5,044,518.50	0.15
195	000531	穗恒运 A	412,000	5,034,640.00	0.15
196	300209	天泽信息	198,823	5,020,280.75	0.15
197	601028	玉龙股份	702,019	5,012,415.66	0.15
198	600159	大龙地产	1,072,800	5,009,976.00	0.15
199	000524	岭南控股	382,939	5,008,842.12	0.15

200	300134	大富科技	166,479	4,987,710.84	0.15
201	300287	飞利信	372,100	4,986,140.00	0.15
202	600277	亿利洁能	837,831	4,985,094.45	0.15
203	600246	万通地产	976,700	4,981,170.00	0.15
204	000501	鄂武商 A	317,347	4,979,174.43	0.15
205	300081	恒信移动	292,250	4,968,250.00	0.15
206	300064	豫金刚石	487,267	4,960,378.06	0.15
207	002133	广宇集团	770,200	4,960,088.00	0.15
208	300096	易联众	269,600	4,944,464.00	0.15
209	000639	西王食品	349,063	4,928,769.56	0.15
210	600979	广安爱众	834,151	4,921,490.90	0.15
211	002550	千红制药	589,230	4,914,178.20	0.15
212	002726	龙大肉食	324,700	4,912,711.00	0.15
213	002567	唐人神	349,300	4,883,214.00	0.15
214	600094	大名城	514,000	4,883,000.00	0.15
215	600006	东风汽车	550,400	4,882,048.00	0.15
216	002050	三花股份	505,100	4,874,215.00	0.15
217	002548	金新农	277,100	4,865,876.00	0.15
218	002082	栋梁新材	306,077	4,860,502.76	0.15
219	601666	平煤股份	1,179,500	4,824,155.00	0.15
220	002392	北京利尔	973,740	4,810,275.60	0.15
221	000631	顺发恒业	987,452	4,808,891.24	0.15
222	002516	旷达科技	796,112	4,800,555.36	0.14
223	300270	中威电子	281,846	4,799,837.38	0.14
224	000301	东方市场	1,103,000	4,775,990.00	0.14
225	300228	富瑞特装	280,544	4,769,248.00	0.14
226	000899	赣能股份	584,284	4,750,228.92	0.14
227	002543	万和电气	256,592	4,744,386.08	0.14
228	000915	山大华特	133,895	4,735,866.15	0.14
229	600665	天地源	974,975	4,728,628.75	0.14
230	300364	中文在线	90,744	4,718,688.00	0.14
231	002126	银轮股份	532,994	4,701,007.08	0.14
232	002124	天邦股份	441,400	4,700,910.00	0.14
233	002057	中钢天源	311,700	4,691,085.00	0.14
234	300283	温州宏丰	499,677	4,686,970.26	0.14
235	000030	富奥股份	653,618	4,686,441.06	0.14
236	002233	塔牌集团	582,601	4,678,286.03	0.14
237	300140	启源装备	210,600	4,675,320.00	0.14
238	002675	东诚药业	99,670	4,637,645.10	0.14
239	600056	中国医药	291,200	4,618,432.00	0.14
240	600993	马应龙	221,344	4,610,595.52	0.14
241	600491	龙元建设	535,200	4,592,016.00	0.14
242	002592	八菱科技	139,050	4,588,650.00	0.14
243	002309	中利科技	255,636	4,578,440.76	0.14

244	600073	上海梅林	398,551	4,563,408.95	0.14
245	600310	桂东电力	555,230	4,558,438.30	0.14
246	600557	康缘药业	278,191	4,542,859.03	0.14
247	600697	欧亚集团	152,860	4,533,827.60	0.14
248	002321	华英农业	481,277	4,533,629.34	0.14
249	000733	振华科技	201,384	4,531,140.00	0.14
250	603001	奥康国际	213,033	4,529,081.58	0.14
251	600983	惠而浦	364,682	4,522,056.80	0.14
252	600330	天通股份	322,355	4,490,405.15	0.14
253	600303	曙光股份	300,722	4,465,721.70	0.13
254	300354	东华测试	166,300	4,465,155.00	0.13
255	000939	凯迪生态	498,200	4,458,890.00	0.13
256	300053	欧比特	245,256	4,451,396.40	0.13
257	002479	富春环保	395,257	4,438,736.11	0.13
258	600084	中葡股份	681,451	4,381,729.93	0.13
259	002651	利君股份	414,850	4,360,073.50	0.13
260	002396	星网锐捷	221,300	4,359,610.00	0.13
261	000973	佛塑科技	416,700	4,350,348.00	0.13
262	000593	大通燃气	345,967	4,345,345.52	0.13
263	002521	齐峰新材	379,834	4,345,300.96	0.13
264	002408	齐翔腾达	788,410	4,328,370.90	0.13
265	002039	黔源电力	224,900	4,324,827.00	0.13
266	600824	益民集团	724,200	4,323,474.00	0.13
267	000099	中信海直	332,444	4,321,772.00	0.13
268	300059	东方财富	193,300	4,291,260.00	0.13
269	000829	天音控股	321,400	4,290,690.00	0.13
270	300333	兆日科技	180,100	4,286,380.00	0.13
271	002198	嘉应制药	414,200	4,282,828.00	0.13
272	600129	太极集团	241,557	4,277,974.47	0.13
273	600480	凌云股份	302,810	4,269,621.00	0.13
274	002474	榕基软件	225,700	4,265,730.00	0.13
275	601579	会稽山	301,600	4,264,624.00	0.13
276	000798	中水渔业	354,980	4,249,110.60	0.13
277	600750	江中药业	133,600	4,248,480.00	0.13
278	600267	海正药业	348,700	4,236,705.00	0.13
279	000759	中百集团	610,396	4,217,836.36	0.13
280	000566	海南海药	386,100	4,212,351.00	0.13
281	300232	洲明科技	265,300	4,205,005.00	0.13
282	000952	广济药业	248,800	4,194,768.00	0.13
283	600629	华建集团	218,656	4,169,769.92	0.13
284	300316	晶盛机电	318,200	4,168,420.00	0.13
285	600711	盛屯矿业	562,800	4,164,720.00	0.13
286	300307	慈星股份	315,199	4,154,322.82	0.13
287	300138	晨光生物	248,445	4,149,031.50	0.13

288	601908	京运通	539,800	4,140,266.00	0.12
289	002367	康力电梯	268,300	4,131,820.00	0.12
290	001696	宗申动力	376,401	4,110,298.92	0.12
291	603168	莎普爱思	93,300	4,105,200.00	0.12
292	600389	江山股份	294,727	4,096,705.30	0.12
293	002002	鸿达兴业	217,501	4,089,018.80	0.12
294	300263	隆华节能	364,854	4,079,067.72	0.12
295	000698	沈阳化工	622,100	4,068,534.00	0.12
296	600127	金健米业	654,700	4,065,687.00	0.12
297	000159	国际实业	532,700	4,064,501.00	0.12
298	600897	厦门空港	193,800	4,062,048.00	0.12
299	002275	桂林三金	219,933	4,059,963.18	0.12
300	002552	宝鼎科技	263,900	4,050,865.00	0.12
301	002251	步步高	312,319	4,050,777.43	0.12
302	300107	建新股份	630,575	4,048,291.50	0.12
303	300426	唐德影视	59,299	4,044,191.80	0.12
304	300132	青松股份	502,700	4,041,708.00	0.12
305	000910	大亚科技	261,276	4,036,714.20	0.12
306	002587	奥拓电子	278,850	4,029,382.50	0.12
307	002334	英威腾	452,200	4,024,580.00	0.12
308	300184	力源信息	363,536	4,009,802.08	0.12
309	300030	阳普医疗	251,100	4,007,556.00	0.12
310	300148	天舟文化	262,907	3,998,815.47	0.12
311	002686	亿利达	295,200	3,997,008.00	0.12
312	600486	扬农化工	145,860	3,996,564.00	0.12
313	300225	金力泰	561,106	3,995,074.72	0.12
314	601007	金陵饭店	318,520	3,991,055.60	0.12
315	300035	中科电气	290,000	3,990,400.00	0.12
316	600558	大西洋	876,675	3,988,871.25	0.12
317	002708	光洋股份	301,000	3,979,220.00	0.12
318	002225	濮耐股份	627,201	3,976,454.34	0.12
319	600501	航天晨光	215,400	3,963,360.00	0.12
320	300243	瑞丰高材	241,500	3,960,600.00	0.12
321	300265	通光线缆	319,772	3,958,777.36	0.12
322	002314	南山控股	578,000	3,947,740.00	0.12
323	000411	英特集团	213,500	3,947,615.00	0.12
324	000700	模塑科技	389,000	3,940,570.00	0.12
325	002208	合肥城建	202,857	3,939,482.94	0.12
326	600742	一汽富维	314,700	3,930,603.00	0.12
327	002419	天虹商场	328,609	3,930,163.64	0.12
328	601058	赛轮金宇	1,173,069	3,918,050.46	0.12
329	600409	三友化工	579,900	3,908,526.00	0.12
330	000407	胜利股份	580,011	3,903,474.03	0.12
331	600883	博闻科技	267,788	3,885,603.88	0.12

332	002374	丽鹏股份	567,100	3,884,635.00	0.12
333	000551	创元科技	422,816	3,881,450.88	0.12
334	600399	抚顺特钢	599,300	3,877,471.00	0.12
335	600685	中船防务	152,733	3,873,308.88	0.12
336	600997	开滦股份	744,000	3,868,800.00	0.12
337	000545	金浦钛业	560,600	3,868,140.00	0.12
338	600216	浙江医药	293,100	3,865,989.00	0.12
339	002496	辉丰股份	659,585	3,858,572.25	0.12
340	600168	武汉控股	393,647	3,841,994.72	0.12
341	300301	长方集团	453,262	3,839,129.14	0.12
342	300099	尤洛卡	436,150	3,838,120.00	0.12
343	600285	羚锐制药	355,600	3,836,924.00	0.12
344	600266	北京城建	305,800	3,819,442.00	0.12
345	002063	远光软件	246,258	3,804,686.10	0.11
346	002054	德美化工	350,714	3,798,232.62	0.11
347	600337	美克家居	291,700	3,795,017.00	0.11
348	600255	鑫科材料	873,395	3,790,534.30	0.11
349	300102	乾照光电	416,100	3,778,188.00	0.11
350	600801	华新水泥	597,406	3,769,631.86	0.11
351	300189	神农基因	672,700	3,767,120.00	0.11
352	600438	通威股份	592,236	3,766,620.96	0.11
353	600720	祁连山	558,800	3,749,548.00	0.11
354	002128	露天煤业	496,917	3,731,846.67	0.11
355	600257	大湖股份	333,399	3,710,730.87	0.11
356	600185	格力地产	595,560	3,698,427.60	0.11
357	000951	中国重汽	384,280	3,673,716.80	0.11
358	600039	四川路桥	930,100	3,664,594.00	0.11
359	300245	天玑科技	164,900	3,660,780.00	0.11
360	600077	宋都股份	753,800	3,648,392.00	0.11
361	002064	华峰氨纶	759,800	3,647,040.00	0.11
362	002191	劲嘉股份	314,227	3,641,890.93	0.11
363	600815	厦工股份	571,425	3,639,977.25	0.11
364	600776	东方通信	432,984	3,632,735.76	0.11
365	300044	赛为智能	280,050	3,632,248.50	0.11
366	002109	*ST 兴化	553,528	3,631,143.68	0.11
367	002348	高乐股份	552,534	3,630,148.38	0.11
368	002012	凯恩股份	415,700	3,620,747.00	0.11
369	000429	粤高速 A	657,600	3,616,800.00	0.11
370	000656	金科股份	942,900	3,601,878.00	0.11
371	000731	四川美丰	498,150	3,601,624.50	0.11
372	002611	东方精工	331,642	3,594,999.28	0.11
373	002574	明牌珠宝	275,200	3,588,608.00	0.11
374	600643	爱建集团	365,347	3,569,440.19	0.11
375	600594	益佰制药	221,800	3,544,364.00	0.11

376	000793	华闻传媒	358,100	3,538,028.00	0.11
377	600803	新奥股份	302,513	3,533,351.84	0.11
378	002185	华天科技	277,550	3,533,211.50	0.11
379	300449	汉邦高科	61,700	3,525,538.00	0.11
380	002328	新朋股份	352,500	3,517,950.00	0.11
381	000960	锡业股份	304,249	3,517,118.44	0.11
382	000608	阳光股份	662,868	3,513,200.40	0.11
383	600970	中材国际	557,568	3,512,678.40	0.11
384	000877	天山股份	565,300	3,493,554.00	0.11
385	600485	信威集团	195,255	3,483,349.20	0.11
386	603077	和邦生物	705,200	3,469,584.00	0.10
387	300226	上海钢联	68,800	3,467,520.00	0.10
388	000525	红太阳	265,006	3,466,278.48	0.10
389	601233	桐昆股份	318,731	3,461,418.66	0.10
390	601929	吉视传媒	855,484	3,447,600.52	0.10
391	002101	广东鸿图	159,120	3,440,174.40	0.10
392	300137	先河环保	232,200	3,434,238.00	0.10
393	002060	粤水电	499,600	3,432,252.00	0.10
394	300310	宜通世纪	89,820	3,430,225.80	0.10
395	601258	庞大集团	1,246,042	3,426,615.50	0.10
396	000690	宝新能源	504,400	3,419,832.00	0.10
397	000979	中弘股份	1,248,020	3,419,574.80	0.10
398	002029	七匹狼	336,649	3,416,987.35	0.10
399	600648	外高桥	172,820	3,406,282.20	0.10
400	000716	黑芝麻	501,960	3,393,249.60	0.10
401	300360	炬华科技	149,198	3,376,350.74	0.10
402	002009	天奇股份	205,900	3,362,347.00	0.10
403	002344	海宁皮城	343,536	3,349,476.00	0.10
404	600215	长春经开	473,400	3,346,938.00	0.10
405	000599	青岛双星	485,700	3,341,616.00	0.10
406	600481	双良节能	582,100	3,335,433.00	0.10
407	300079	数码视讯	388,906	3,332,924.42	0.10
408	000885	同力水泥	259,375	3,322,593.75	0.10
409	000797	中国武夷	221,946	3,315,873.24	0.10
410	600237	铜峰电子	435,000	3,310,350.00	0.10
411	002154	报喜鸟	684,600	3,306,618.00	0.10
412	600894	广日股份	246,724	3,288,830.92	0.10
413	002033	丽江旅游	259,112	3,285,540.16	0.10
414	600169	太原重工	838,000	3,268,200.00	0.10
415	000748	长城信息	165,700	3,251,034.00	0.10
416	000521	美菱电器	536,940	3,237,748.20	0.10
417	002005	德豪润达	544,100	3,215,631.00	0.10
418	300211	亿通科技	234,148	3,214,852.04	0.10
419	601989	中国重工	507,500	3,212,475.00	0.10

420	000875	吉电股份	570,600	3,201,066.00	0.10
421	600775	南京熊猫	213,400	3,190,330.00	0.10
422	300291	华录百纳	135,562	3,189,773.86	0.10
423	300334	津膜科技	176,537	3,186,492.85	0.10
424	002534	杭锅股份	297,796	3,171,527.40	0.10
425	002011	盾安环境	280,842	3,167,897.76	0.10
426	600587	新华医疗	136,418	3,149,891.62	0.09
427	000070	特发信息	120,098	3,148,969.56	0.09
428	600020	中原高速	711,440	3,144,564.80	0.09
429	600655	豫园商城	289,400	3,137,096.00	0.09
430	600230	*ST 沧大	312,243	3,094,328.13	0.09
431	002376	新北洋	230,800	3,083,488.00	0.09
432	000861	海印股份	623,528	3,080,228.32	0.09
433	002026	山东威达	244,400	3,072,108.00	0.09
434	002599	盛通股份	85,400	3,059,028.00	0.09
435	000669	金鸿能源	183,102	3,057,803.40	0.09
436	002144	宏达高科	155,500	3,057,130.00	0.09
437	000893	东凌国际	241,400	3,036,812.00	0.09
438	600280	中央商场	449,200	3,036,592.00	0.09
439	300147	香雪制药	205,865	3,032,391.45	0.09
440	002614	蒙发利	250,800	3,012,108.00	0.09
441	300150	世纪瑞尔	277,770	3,008,249.10	0.09
442	300295	三六五网	92,400	3,003,000.00	0.09
443	600252	中恒集团	690,300	2,995,902.00	0.09
444	300237	美晨科技	316,900	2,985,198.00	0.09
445	000818	方大化工	451,119	2,963,851.83	0.09
446	002336	*ST 人乐	291,300	2,956,695.00	0.09
447	600361	华联综超	473,400	2,949,282.00	0.09
448	002386	天原集团	411,370	2,937,181.80	0.09
449	000811	烟台冰轮	261,143	2,930,024.46	0.09
450	300007	汉威电子	104,900	2,928,808.00	0.09
451	002258	利尔化学	311,880	2,928,553.20	0.09
452	002743	富煌钢构	202,400	2,918,608.00	0.09
453	002261	拓维信息	210,426	2,910,191.58	0.09
454	300018	中元股份	228,632	2,905,912.72	0.09
455	002498	汉缆股份	663,315	2,878,787.10	0.09
456	600835	上海机电	149,570	2,870,248.30	0.09
457	002420	毅昌股份	329,652	2,867,972.40	0.09
458	002218	拓日新能	278,000	2,835,600.00	0.09
459	000665	湖北广电	190,307	2,820,349.74	0.09
460	002274	华昌化工	261,600	2,746,800.00	0.08
461	000156	华数传媒	147,928	2,744,064.40	0.08
462	002087	新野纺织	344,700	2,719,683.00	0.08
463	603003	龙宇燃油	141,900	2,718,804.00	0.08



464	000693	ST 华泽	216,525	2,706,562.50	0.08
465	600292	远达环保	211,199	2,675,891.33	0.08
466	300183	东软载波	100,600	2,665,900.00	0.08
467	600175	美都能源	565,100	2,655,970.00	0.08
468	600375	*ST 星马	459,800	2,648,448.00	0.08
469	000027	深圳能源	414,395	2,643,840.10	0.08
470	002622	永大集团	214,600	2,639,580.00	0.08
471	600023	浙能电力	509,700	2,594,373.00	0.08
472	600416	湘电股份	207,500	2,587,525.00	0.08
473	600449	宁夏建材	286,448	2,583,760.96	0.08
474	300039	上海凯宝	252,020	2,563,043.40	0.08
475	000428	华天酒店	390,400	2,561,024.00	0.08
476	300178	腾邦国际	133,089	2,555,308.80	0.08
477	600249	两面针	365,800	2,553,284.00	0.08
478	601898	中煤能源	491,100	2,534,076.00	0.08
479	300213	佳讯飞鸿	89,621	2,530,897.04	0.08
480	601699	潞安环能	384,300	2,513,322.00	0.08
481	600881	亚泰集团	520,023	2,506,510.86	0.08
482	603099	长白山	139,900	2,505,609.00	0.08
483	600397	安源煤业	562,100	2,484,482.00	0.07
484	300066	三川智慧	252,625	2,473,198.75	0.07
485	601777	力帆股份	209,600	2,466,992.00	0.07
486	600616	金枫酒业	237,300	2,425,206.00	0.07
487	300284	苏交科	101,507	2,396,580.27	0.07
488	002387	黑牛食品	130,500	2,395,980.00	0.07
489	600308	华泰股份	488,300	2,382,904.00	0.07
490	002330	得利斯	221,100	2,374,614.00	0.07
491	601636	旗滨集团	741,900	2,359,242.00	0.07
492	601616	广电电气	415,000	2,348,900.00	0.07
493	300020	银江股份	125,800	2,339,880.00	0.07
494	600875	东方电气	236,400	2,321,448.00	0.07
495	300392	腾信股份	85,400	2,312,632.00	0.07
496	300303	聚飞光电	242,280	2,304,082.80	0.07
497	002461	珠江啤酒	195,656	2,273,522.72	0.07
498	300129	泰胜风能	324,100	2,268,700.00	0.07
499	300202	聚龙股份	92,343	2,235,624.03	0.07
500	002665	首航节能	281,881	2,224,041.09	0.07
501	600279	重庆港九	309,900	2,209,587.00	0.07
502	000900	现代投资	327,104	2,204,680.96	0.07
503	300153	科泰电源	81,440	2,198,065.60	0.07
504	300415	伊之密	128,013	2,196,703.08	0.07
505	601117	中国化学	396,200	2,190,986.00	0.07
506	300104	乐视网	41,000	2,169,310.00	0.07
507	600963	岳阳林纸	350,900	2,147,508.00	0.06

508	300026	红日药业	122,600	2,132,014.00	0.06
509	300207	欣旺达	82,758	2,124,397.86	0.06
510	000589	黔轮胎 A	404,300	2,122,575.00	0.06
511	600026	中海发展	356,500	2,103,350.00	0.06
512	002228	合兴包装	374,000	2,079,440.00	0.06
513	600546	*ST 山煤	648,500	1,990,895.00	0.06
514	300161	华中数控	64,400	1,973,860.00	0.06
515	300271	华宇软件	104,100	1,969,572.00	0.06
516	000709	河钢股份	702,100	1,944,817.00	0.06
517	300257	开山股份	117,600	1,942,752.00	0.06
518	300119	瑞普生物	120,950	1,941,247.50	0.06
519	603806	福斯特	37,100	1,936,249.00	0.06
520	600498	烽火通信	78,861	1,914,745.08	0.06
521	300158	振东制药	118,200	1,908,930.00	0.06
522	600241	时代万恒	84,600	1,887,426.00	0.06
523	300269	联建光电	72,500	1,883,550.00	0.06
524	300349	金卡股份	43,800	1,883,400.00	0.06
525	300471	厚普股份	38,950	1,863,368.00	0.06
526	601099	太平洋	294,030	1,802,403.90	0.05
527	300205	天喻信息	120,400	1,780,716.00	0.05
528	300203	聚光科技	66,800	1,763,520.00	0.05
529	300122	智飞生物	111,800	1,729,546.00	0.05
530	300313	天山生物	105,100	1,723,640.00	0.05
531	002318	久立特材	147,300	1,704,261.00	0.05
532	002260	德奥通航	65,582	1,701,852.90	0.05
533	002352	鼎泰新材	35,000	1,682,800.00	0.05
534	300326	凯利泰	67,100	1,676,829.00	0.05
535	002003	伟星股份	106,618	1,666,439.34	0.05
536	300012	华测检测	134,600	1,666,348.00	0.05
537	600203	福日电子	120,300	1,660,140.00	0.05
538	300375	鹏翎股份	60,929	1,646,910.87	0.05
539	300408	三环集团	91,400	1,641,544.00	0.05
540	300101	振芯科技	58,081	1,622,202.33	0.05
541	300155	安居宝	110,200	1,617,736.00	0.05
542	002322	理工环科	85,300	1,615,582.00	0.05
543	300357	我武生物	42,883	1,614,973.78	0.05
544	300390	天华超净	93,500	1,613,810.00	0.05
545	000415	渤海金控	236,600	1,613,612.00	0.05
546	600523	贵航股份	85,677	1,591,878.66	0.05
547	300238	冠昊生物	36,222	1,589,421.36	0.05
548	300001	特锐德	72,800	1,579,032.00	0.05
549	002438	江苏神通	71,800	1,571,702.00	0.05
550	300168	万达信息	60,400	1,569,796.00	0.05
551	000546	金圆股份	147,200	1,551,488.00	0.05

552	002535	林州重机	191,631	1,548,378.48	0.05
553	000635	英力特	128,400	1,545,936.00	0.05
554	300253	卫宁健康	62,557	1,545,157.90	0.05
555	600192	长城电工	144,100	1,544,752.00	0.05
556	002014	永新股份	96,580	1,540,451.00	0.05
557	000908	景峰医药	127,380	1,538,750.40	0.05
558	600681	百川能源	141,600	1,534,944.00	0.05
559	600967	北方创业	144,300	1,533,909.00	0.05
560	601518	吉林高速	389,800	1,528,016.00	0.05
561	601313	江南嘉捷	105,400	1,526,192.00	0.05
562	300114	中航电测	51,100	1,522,780.00	0.05
563	002748	世龙实业	91,400	1,521,810.00	0.05
564	000816	智慧农业	257,457	1,521,570.87	0.05
565	000157	中联重科	366,900	1,515,297.00	0.05
566	002125	湘潭电化	75,700	1,514,000.00	0.05
567	002632	道明光学	125,400	1,502,292.00	0.05
568	601717	郑煤机	263,300	1,500,810.00	0.05
569	603699	纽威股份	84,596	1,500,733.04	0.05
570	002478	常宝股份	132,999	1,494,908.76	0.05
571	002435	长江润发	83,000	1,493,170.00	0.05
572	000528	柳工	228,800	1,482,624.00	0.04
573	601678	滨化股份	290,845	1,480,401.05	0.04
574	000564	西安民生	154,186	1,480,185.60	0.04
575	603008	喜临门	86,091	1,479,904.29	0.04
576	600580	卧龙电气	132,000	1,479,720.00	0.04
577	300078	思创医惠	44,200	1,478,048.00	0.04
578	000780	平庄能源	272,490	1,476,895.80	0.04
579	600640	号百控股	87,800	1,474,162.00	0.04
580	601015	陕西黑猫	127,329	1,473,196.53	0.04
581	300395	菲利华	55,007	1,473,087.46	0.04
582	002037	久联发展	90,933	1,471,295.94	0.04
583	002666	德联集团	158,900	1,468,236.00	0.04
584	600078	澄星股份	226,500	1,465,455.00	0.04
585	000425	徐工机械	477,700	1,461,762.00	0.04
586	000422	湖北宜化	238,400	1,456,624.00	0.04
587	600281	太化股份	234,212	1,452,114.40	0.04
588	300242	明家联合	41,358	1,447,116.42	0.04
589	002725	跃岭股份	62,902	1,443,600.90	0.04
590	002004	华邦健康	158,000	1,442,540.00	0.04
591	603123	翠微股份	169,700	1,439,056.00	0.04
592	002170	芭田股份	170,500	1,439,020.00	0.04
593	600222	太龙药业	180,500	1,438,585.00	0.04
594	300195	长荣股份	77,500	1,437,625.00	0.04
595	601177	杭齿前进	145,800	1,437,588.00	0.04

596	600613	神奇制药	100,399	1,435,705.70	0.04
597	603616	韩建河山	51,800	1,434,860.00	0.04
598	600121	郑州煤电	298,700	1,433,760.00	0.04
599	600981	汇鸿集团	169,373	1,427,814.39	0.04
600	000505	*ST 珠江	144,900	1,425,816.00	0.04
601	300052	中青宝	64,700	1,425,341.00	0.04
602	002088	鲁阳节能	91,526	1,424,144.56	0.04
603	000935	四川双马	211,400	1,422,722.00	0.04
604	000825	太钢不锈	448,800	1,418,208.00	0.04
605	300475	聚隆科技	52,600	1,417,044.00	0.04
606	600509	天富能源	192,500	1,414,875.00	0.04
607	002158	汉钟精机	114,624	1,413,313.92	0.04
608	600814	杭州解百	133,136	1,409,910.24	0.04
609	600461	洪城水业	108,400	1,407,032.00	0.04
610	600758	红阳能源	134,300	1,403,435.00	0.04
611	603158	腾龙股份	58,900	1,402,998.00	0.04
612	601155	新城控股	151,300	1,401,038.00	0.04
613	000739	普洛药业	225,300	1,399,113.00	0.04
614	300152	科融环境	185,500	1,398,670.00	0.04
615	603558	健盛集团	73,900	1,394,493.00	0.04
616	600082	海泰发展	240,200	1,390,758.00	0.04
617	603969	银龙股份	103,800	1,383,654.00	0.04
618	600269	赣粤高速	317,100	1,379,385.00	0.04
619	603333	明星电缆	185,735	1,378,153.70	0.04
620	603116	红蜻蜓	58,111	1,376,068.48	0.04
621	002705	新宝股份	88,050	1,375,341.00	0.04
622	002561	徐家汇	112,700	1,370,432.00	0.04
623	600483	福能股份	120,700	1,369,945.00	0.04
624	002648	卫星石化	151,300	1,367,752.00	0.04
625	000830	鲁西化工	301,900	1,364,588.00	0.04
626	000958	东方能源	98,387	1,362,659.95	0.04
627	603010	万盛股份	61,400	1,358,168.00	0.04
628	603011	合锻智能	117,200	1,354,832.00	0.04
629	002763	汇洁股份	39,700	1,353,770.00	0.04
630	300109	新开源	21,299	1,352,486.50	0.04
631	002357	富临运业	87,600	1,351,668.00	0.04
632	000539	粤电力 A	269,200	1,351,384.00	0.04
633	002523	天桥起重	231,736	1,351,020.88	0.04
634	300055	万邦达	74,100	1,349,361.00	0.04
635	000906	物产中拓	113,200	1,343,684.00	0.04
636	000950	*ST 建峰	180,000	1,341,000.00	0.04
637	600810	神马股份	179,461	1,340,573.67	0.04
638	000421	南京公用	133,800	1,339,338.00	0.04
639	000692	惠天热电	239,638	1,337,180.04	0.04

640	002391	长青股份	93,400	1,335,620.00	0.04
641	600971	恒源煤电	241,300	1,331,976.00	0.04
642	300339	润和软件	37,100	1,329,664.00	0.04
643	600248	延长化建	217,230	1,325,103.00	0.04
644	002059	云南旅游	154,800	1,325,088.00	0.04
645	600622	嘉宝集团	96,200	1,322,750.00	0.04
646	601107	四川成渝	267,600	1,311,240.00	0.04
647	300182	捷成股份	76,595	1,310,540.45	0.04
648	000902	新洋丰	104,300	1,304,793.00	0.04
649	600057	象屿股份	126,500	1,300,420.00	0.04
650	002682	龙洲股份	102,454	1,300,141.26	0.04
651	300405	科隆精化	28,200	1,297,482.00	0.04
652	600548	深高速	166,400	1,296,256.00	0.04
653	000609	绵世股份	100,666	1,291,544.78	0.04
654	600617	国新能源	112,697	1,291,507.62	0.04
655	000672	上峰水泥	217,997	1,290,542.24	0.04
656	002696	百洋股份	67,200	1,286,208.00	0.04
657	000563	陕国投 A	234,100	1,285,209.00	0.04
658	002381	双箭股份	97,700	1,284,755.00	0.04
659	002483	润邦股份	111,100	1,282,094.00	0.04
660	600792	云煤能源	252,800	1,281,696.00	0.04
661	002397	梦洁家纺	155,600	1,280,588.00	0.04
662	300125	易世达	51,600	1,280,196.00	0.04
663	300293	蓝英装备	71,403	1,278,113.70	0.04
664	300019	硅宝科技	70,900	1,275,491.00	0.04
665	300146	汤臣倍健	94,200	1,275,468.00	0.04
666	002731	萃华珠宝	47,600	1,271,396.00	0.04
667	600573	惠泉啤酒	95,700	1,270,896.00	0.04
668	000880	潍柴重机	92,813	1,266,897.45	0.04
669	002749	国光股份	15,400	1,263,108.00	0.04
670	300003	乐普医疗	69,110	1,260,566.40	0.04
671	000544	中原环保	88,200	1,260,378.00	0.04
672	002756	永兴特钢	55,170	1,258,979.40	0.04
673	600982	宁波热电	239,000	1,257,140.00	0.04
674	603611	诺力股份	49,300	1,250,741.00	0.04
675	000498	山东路桥	216,900	1,249,344.00	0.04
676	000859	国风塑业	231,500	1,240,840.00	0.04
677	000045	深纺织 A	91,300	1,239,854.00	0.04
678	000850	华茂股份	211,500	1,237,275.00	0.04
679	002046	轴研科技	118,848	1,227,699.84	0.04
680	300075	数字政通	47,785	1,225,685.25	0.04
681	000537	广宇发展	152,900	1,224,729.00	0.04
682	300124	汇川技术	62,996	1,222,122.40	0.04
683	002637	赞宇科技	97,300	1,221,115.00	0.04

684	002593	日上集团	159,900	1,218,438.00	0.04
685	000928	中钢国际	96,527	1,214,309.66	0.04
686	600569	安阳钢铁	469,400	1,211,052.00	0.04
687	300402	宝色股份	73,401	1,209,648.48	0.04
688	300120	经纬电材	81,500	1,208,645.00	0.04
689	600658	电子城	116,799	1,206,533.67	0.04
690	002671	龙泉股份	97,200	1,200,420.00	0.04
691	002641	永高股份	145,658	1,200,221.92	0.04
692	600295	鄂尔多斯	152,000	1,199,280.00	0.04
693	603018	设计股份	41,500	1,197,690.00	0.04
694	300098	高新兴	75,200	1,194,176.00	0.04
695	002457	青龙管业	116,100	1,192,347.00	0.04
696	600865	百大集团	100,800	1,190,448.00	0.04
697	002742	三圣特材	51,400	1,188,368.00	0.04
698	300355	蒙草生态	167,100	1,188,081.00	0.04
699	002078	太阳纸业	242,400	1,182,912.00	0.04
700	002576	通达动力	62,800	1,182,524.00	0.04
701	000889	茂业通信	108,898	1,181,543.30	0.04
702	601996	丰林集团	153,800	1,176,570.00	0.04
703	603968	醋化股份	50,500	1,171,095.00	0.04
704	600475	华光股份	78,711	1,168,858.35	0.04
705	601226	华电重工	127,400	1,168,258.00	0.04
706	300185	通裕重工	130,100	1,160,492.00	0.03
707	300233	金城医药	44,605	1,154,823.45	0.03
708	601368	绿城水务	87,800	1,154,570.00	0.03
709	000552	靖远煤电	327,300	1,152,096.00	0.03
710	300156	神雾环保	55,950	1,151,451.00	0.03
711	300378	鼎捷软件	40,070	1,150,810.40	0.03
712	300262	巴安水务	73,860	1,131,535.20	0.03
713	600162	香江控股	269,100	1,127,529.00	0.03
714	300366	创意信息	29,500	1,116,870.00	0.03
715	300177	中海达	73,533	1,114,760.28	0.03
716	600724	宁波富达	217,000	1,106,700.00	0.03
717	300289	利德曼	73,600	1,101,056.00	0.03
718	300439	美康生物	30,600	1,100,988.00	0.03
719	300224	正海磁材	47,700	1,081,359.00	0.03
720	300300	汉鼎宇佑	35,300	1,078,768.00	0.03
721	300043	互动娱乐	75,100	1,064,167.00	0.03
722	300054	鼎龙股份	41,300	1,033,326.00	0.03
723	600297	广汇汽车	117,500	1,023,425.00	0.03
724	300383	光环新网	26,700	1,011,930.00	0.03
725	300309	吉艾科技	76,100	1,010,608.00	0.03
726	300431	暴风集团	13,600	986,000.00	0.03
727	300385	雪浪环境	27,600	984,492.00	0.03

728	300345	红宇新材	90,400	945,584.00	0.03
729	300218	安利股份	61,045	939,482.55	0.03
730	300198	纳川股份	57,800	930,002.00	0.03
731	300342	天银机电	30,212	920,257.52	0.03
732	300370	安控科技	79,212	899,848.32	0.03
733	300065	海兰信	23,000	889,640.00	0.03
734	300229	拓尔思	41,200	880,856.00	0.03
735	300004	南风股份	44,447	871,161.20	0.03
736	300428	四通新材	14,100	860,946.00	0.03
737	300236	上海新阳	17,000	860,030.00	0.03
738	300172	中电环保	93,200	858,372.00	0.03
739	300348	长亮科技	23,200	857,472.00	0.03
740	300465	高伟达	11,300	849,082.00	0.03
741	000063	中兴通讯	59,200	848,928.00	0.03
742	300144	宋城演艺	33,872	843,751.52	0.03
743	601001	大同煤业	156,600	840,942.00	0.03
744	300076	GQY 视讯	71,000	828,570.00	0.02
745	300212	易华录	27,774	826,831.98	0.02
746	300034	钢研高纳	37,279	823,865.90	0.02
747	600050	中国联通	212,219	808,554.39	0.02
748	002797	第一创业	19,929	805,330.89	0.02
749	300166	东方国信	29,300	804,871.00	0.02
750	300077	国民技术	39,600	784,080.00	0.02
751	601611	中国核建	37,059	775,274.28	0.02
752	300016	北陆药业	32,400	740,340.00	0.02
753	300136	信维通信	33,380	699,644.80	0.02
754	300234	开尔新材	31,733	685,432.80	0.02
755	300100	双林股份	15,600	683,436.00	0.02
756	300024	机器人	26,560	674,358.40	0.02
757	300013	新宁物流	35,900	644,405.00	0.02
758	300455	康拓红外	28,500	639,540.00	0.02
759	600019	宝钢股份	128,800	631,120.00	0.02
760	300089	文化长城	51,000	628,320.00	0.02
761	300285	国瓷材料	15,600	622,284.00	0.02
762	300094	国联水产	42,400	619,888.00	0.02
763	300256	星星科技	34,200	619,704.00	0.02
764	300261	雅本化学	50,191	610,824.47	0.02
765	300201	海伦哲	32,100	605,085.00	0.02
766	300272	开能环保	38,800	598,684.00	0.02
767	300011	鼎汉技术	25,400	596,138.00	0.02
768	300281	金明精机	39,600	587,664.00	0.02
769	300061	康耐特	19,900	573,916.00	0.02
770	300297	蓝盾股份	34,800	554,364.00	0.02
771	600196	复星医药	28,000	532,560.00	0.02

772	300087	荃银高科	46,100	525,540.00	0.02
773	300005	探路者	30,200	514,910.00	0.02
774	300032	金龙机电	25,600	514,560.00	0.02
775	300204	舒泰神	27,598	508,907.12	0.02
776	002052	同洲电子	50,100	502,503.00	0.02
777	300437	清水源	18,260	498,680.60	0.02
778	601607	上海医药	27,300	492,765.00	0.01
779	300299	富春通信	17,600	484,176.00	0.01
780	300384	三联虹普	9,400	472,820.00	0.01
781	300017	网宿科技	6,979	468,988.80	0.01
782	300359	全通教育	15,800	468,628.00	0.01
783	300115	长盈精密	21,020	433,012.00	0.01
784	600048	保利地产	48,800	421,144.00	0.01
785	300413	快乐购	16,800	409,080.00	0.01
786	300474	景嘉微	2,467	372,196.29	0.01
787	601900	南方传媒	18,362	324,456.54	0.01
788	603377	东方时尚	6,936	315,518.64	0.01
789	603528	多伦科技	3,112	304,944.88	0.01
790	002792	通宇通讯	4,622	276,395.60	0.01
791	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
792	000778	新兴铸管	55,000	255,200.00	0.01
793	000553	沙隆达 A	23,874	254,974.32	0.01
794	601992	金隅股份	31,900	247,225.00	0.01
795	300508	维宏股份	970	246,865.00	0.01
796	002788	鹭燕医药	3,663	236,556.54	0.01
797	603520	司太立	4,360	230,992.80	0.01
798	002791	坚朗五金	3,973	213,628.21	0.01
799	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
800	603919	金徽酒	6,604	204,063.60	0.01
801	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
802	603868	飞科电器	3,293	194,780.95	0.01
803	603608	天创时尚	7,994	191,616.18	0.01
804	300511	雪榕生物	2,872	191,361.36	0.01
805	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.01
806	300503	昊志机电	1,863	157,833.36	0.00
807	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
808	603339	四方冷链	2,793	151,995.06	0.00
809	002790	瑞尔特	3,022	143,393.90	0.00
810	603861	白云电器	4,056	134,496.96	0.00
811	601020	华钰矿业	4,377	125,444.82	0.00
812	603779	威龙股份	2,809	117,865.64	0.00
813	603959	百利科技	2,815	116,681.75	0.00
814	300505	川金诺	1,893	114,450.78	0.00
815	002789	建艺集团	1,500	107,520.00	0.00



816	603101	汇嘉时代	3,563	106,248.66	0.00
817	603027	千禾味业	2,904	102,424.08	0.00
818	002795	永和智控	1,450	98,716.00	0.00
819	603028	赛福天	3,309	97,317.69	0.00
820	300510	金冠电气	1,365	92,219.40	0.00
821	002793	东音股份	1,413	91,859.13	0.00
822	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.00
823	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
824	603029	天鹅股份	1,618	72,211.34	0.00
825	603726	朗迪集团	1,361	68,798.55	0.00
826	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.00
827	300518	N 盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
828	300418	昆仑万维	1,962	55,465.74	0.00
829	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
830	002783	凯龙股份	500	44,940.00	0.00
831	300427	红相电力	1,600	35,024.00	0.00
832	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
833	002733	雄韬股份	1,125	33,131.25	0.00
834	300434	金石东方	1,000	29,660.00	0.00
835	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
836	601198	东兴证券	1,000	24,440.00	0.00
837	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
838	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
839	002732	燕塘乳业	500	13,295.00	0.00
840	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
841	300452	山河药辅	142	6,918.24	0.00
842	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
843	300457	赢合科技	50	3,870.50	0.00
844	600408	安泰集团	68	399.84	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	601398	工商银行	21,630,802.52	0.56
2	002566	益盛药业	19,648,548.94	0.51
3	600208	新湖中宝	17,866,461.69	0.46
4	601288	农业银行	17,590,918.92	0.45
5	600657	信达地产	17,461,130.12	0.45
6	601328	交通银行	17,335,666.00	0.45

7	600239	云南城投	16,827,399.11	0.43
8	600056	中国医药	16,129,621.40	0.42
9	600017	日照港	15,283,529.87	0.39
10	600765	中航重机	15,183,886.78	0.39
11	600642	申能股份	14,697,774.48	0.38
12	000793	华闻传媒	13,625,080.91	0.35
13	000166	申万宏源	13,618,712.72	0.35
14	601988	中国银行	13,493,845.00	0.35
15	300090	盛运环保	13,256,579.68	0.34
16	600533	栖霞建设	13,233,932.19	0.34
17	600805	悦达投资	13,179,622.29	0.34
18	603366	日出东方	13,080,425.51	0.34
19	600238	海南椰岛	12,505,781.52	0.32
20	600815	厦工股份	12,301,992.64	0.32

#### 7.4.2 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	000001	平安银行	38,392,939.52	0.99
2	600036	招商银行	32,792,639.78	0.85
3	601166	兴业银行	29,170,527.16	0.75
4	000166	申万宏源	28,359,963.19	0.73
5	601988	中国银行	25,482,502.00	0.66
6	600208	新湖中宝	18,696,466.76	0.48
7	000686	东北证券	17,637,395.78	0.46
8	000881	大连国际	15,835,507.65	0.41
9	601398	工商银行	15,583,560.00	0.40
10	601939	建设银行	15,531,601.40	0.40
11	600104	上汽集团	15,301,655.82	0.39
12	600056	中国医药	15,171,922.50	0.39
13	600199	金种子酒	15,046,863.96	0.39
14	601009	南京银行	14,545,792.40	0.38
15	002279	久其软件	14,302,905.00	0.37
16	601998	中信银行	13,990,941.97	0.36
17	300059	东方财富	13,933,088.12	0.36
18	300209	天泽信息	13,837,355.87	0.36
19	000426	兴业矿业	13,707,620.80	0.35
20	600661	新南洋	13,457,138.72	0.35

#### 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	3,485,062,174.88
卖出股票的收入（成交）总额	3,716,396,981.70

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

本基金本报告期不能投资股指期货。

#### 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中，益盛药业于 2016 年 4 月 25 日、2016 年 5 月 25 日、2016 年 6 月 24 日发布公告表示，公司及实际控制人张益胜先生于 2015 年 12 月 25 日分别收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》，决定对公司及张益胜先生予以立案调查。

对该股票投资决策程序的说明：投资研究部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究，在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该行政处罚事件发生后，本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该股票投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

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	417,406.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	73,371.18
5	应收申购款	517,308.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,008,086.25

### 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可转债。

### 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	占基金资产净	流通受限情
----	------	------	---------	--------	-------

			公允价值	值比例(%)	况说明
1	000728	国元证券	11,472,110.32	0.35	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
176,948	14,236.25	5,030,365.35	0.20%	2,514,045,467.83	99.80%

### 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	9,221.66	0.00%

### 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	0
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	2,522,166,950.02
本报告期基金总申购份额	105,204,726.49
减：本报告期基金总赎回份额	108,295,843.33
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	2,519,075,833.18
-------------	------------------

## 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

经公司八届二十一次董事会会议审议通过，自 2016 年 3 月 3 日起，陶耿先生正式离任公司总经理一职，由林昌先生代任公司总经理。经公司九届二次董事会会议审议通过，自 2016 年 7 月 19 日起，包爱丽女士正式担任公司总经理一职，林昌先生不再代任公司总经理，将继续担任公司董事长。

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

本报告期内，本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门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。

### 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	
高华证券	1	1,028,877.00	0.01%	958.18	0.01%	-
国金证券	1	135,838,031.66	1.89%	123,789.83	1.87%	-
中银国际	1	202,010,629.72	2.81%	188,134.06	2.84%	-
中泰证券	1	229,225,407.07	3.18%	213,477.04	3.23%	-
宏源证券	1	292,116,549.60	4.06%	266,206.32	4.02%	-
东方证券	1	292,404,044.12	4.06%	272,314.50	4.11%	-

广发证券	1	363,307,302.50	5.05%	331,082.45	5.00%	-
国信证券	1	398,375,836.75	5.53%	363,039.91	5.48%	-
中信建投	1	435,720,457.51	6.05%	405,786.72	6.13%	-
光大证券	3	454,186,600.87	6.31%	413,900.82	6.25%	-
中金公司	1	492,947,567.14	6.85%	459,079.60	6.94%	-
中信证券	1	532,628,123.92	7.40%	496,035.86	7.49%	-
长江证券	1	730,777,468.46	10.15%	680,571.88	10.28%	-
中投建银	1	740,315,169.25	10.28%	674,650.65	10.19%	-
海通证券	1	1,898,482,899.44	26.37%	1,730,091.12	26.14%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）新增租用交易单元：本基金报告期内未新增租用交易单元。

（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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投建银	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-



注：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	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-04
2	关于旗下部分基金新增联讯证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-08
3	光大保德信基金管理有限公司新增海银基金销售有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-14
4	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-01-20
5	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-28
6	光大保德信量化核心证券投资基金 2015 年年度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-03-28
7	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》	2016-04-01
8	光大保德信基金管理有限公司关于调整招商银行“一卡通”借记卡网上直销平台（含移动终端）交易费率的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-07
9	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》	2016-04-09
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》	2016-04-09
11	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》	2016-04-15
12	光大保德信量化核心证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-04-22
13	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》	2016-04-26
14	有关旗下部分基金参加中国民生银行直销银行“基金通”平台费用优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-05-14
15	关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售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》	2016-05-27
16	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在平安证券开通定期定额投资及转换业务并参与其费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-14

17	光大保德信基金管理有限公司关于参与上海联泰资产管理有限公司申购费优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-18
18	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务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》	2016-06-24
19	光大保德信基金管理有限公司旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016-06-29

## 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

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼）6 层至 10 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

二〇一六年八月二十七日