

# 南方策略优化股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 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> .....                        | <b>8</b>  |
| 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合规守信情况的说明.....              | 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.....                 | 11        |
| 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> .....                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12        |
| 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> .....                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 38        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 39        |
| 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.....       | 40        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 56        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 58        |
| 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.....      | 58        |
| 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.....                           | 59        |
| <b>§8 基金份额持有人信息</b> .....                    | <b>60</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....             | 60        |
| 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>61</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 61        |
| 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 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 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.....                       | 63        |
| <b>§11 备查文件目录.....</b>                 | <b>69</b> |
| 11.1 备查文件目录.....                       | 69        |
| 11.2 存放地点.....                         | 69        |
| 11.3 查阅方式.....                         | 70        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 南方策略优化股票型证券投资基金     |
| 基金简称       | 南方策略优化股票            |
| 场内简称       | -                   |
| 基金主代码      | 202019              |
| 前端交易代码     | 202019              |
| 后端交易代码     | 202020              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2010 年 3 月 30 日     |
| 基金管理人      | 南方基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司          |
| 报告期末基金份额总额 | 382, 254, 629. 57 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方策略”。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金通过数量化手段优化投资策略，在积极把握证券市场及相关行业发展趋势的前提下精选优势个股进行投资，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | 本基金投资策略包含资产配置、行业配置和个股选择等三个层面。基金管理人在综合分析经济周期、财政政策、市场环境等因素的基础上，采用定量和定性相结合的思路确定本基金的资产配置。针对本基金的行业配置策略，基金管理人开发了基于 lack-Litterman 模型的“南方量化行业配置模型”。在行业配置的基础上，进一步使用“南方多因子量化选股模型”，依据基本面、价值面、市场面和流动性等因素对股票进行综合评分，精选各行业具有超额收益能力或潜力的优势个股，构建本基金的股票组合。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深 300 指数+20%×上证国债指数   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金、债券基金及货币市场基金。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|
|----|-------|-------|

|         |                                 |                          |                        |
|---------|---------------------------------|--------------------------|------------------------|
| 名称      | 南方基金管理有限公司                      | 招商银行股份有限公司               |                        |
| 信息披露负责人 | 姓名                              | 鲍文革                      | 张燕                     |
|         | 联系电话                            | 0755-82763888            | 0755-83199084          |
|         | 电子邮箱                            | manager@southernfund.com | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话  | 400-889-8899                    | 95555                    |                        |
| 传真      | 0755-82763889                   | 0755-83195201            |                        |
| 注册地址    | 深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层 | 中国深圳深南大道7088号招商银行大厦      |                        |
| 办公地址    | 深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层 | 中国深圳深南大道7088号招商银行大厦      |                        |
| 邮政编码    | 518048                          | 518040                   |                        |
| 法定代表人   | 吴万善                             | 李建红                      |                        |

## 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 | <a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公地址  |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                            |
|--------|------------|---------------------------------|
| 注册登记机构 | 南方基金管理有限公司 | 深圳市福田区福华一路六号免税商务大厦塔楼31、32、33层整层 |

## §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 - 2015年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 399,093,742.73              |
| 本期利润          | 271,275,107.46              |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.5196                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 43.49%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | 62.22%                      |
| 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            | 193,800,814.04          |
| 期末可供分配基金份额利润        | 0.5070                  |
| 期末基金资产净值            | 576,055,443.61          |
| 期末基金份额净值            | 1.507                   |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b> | <b>报告期末(2015年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率         | 53.70%                  |

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。

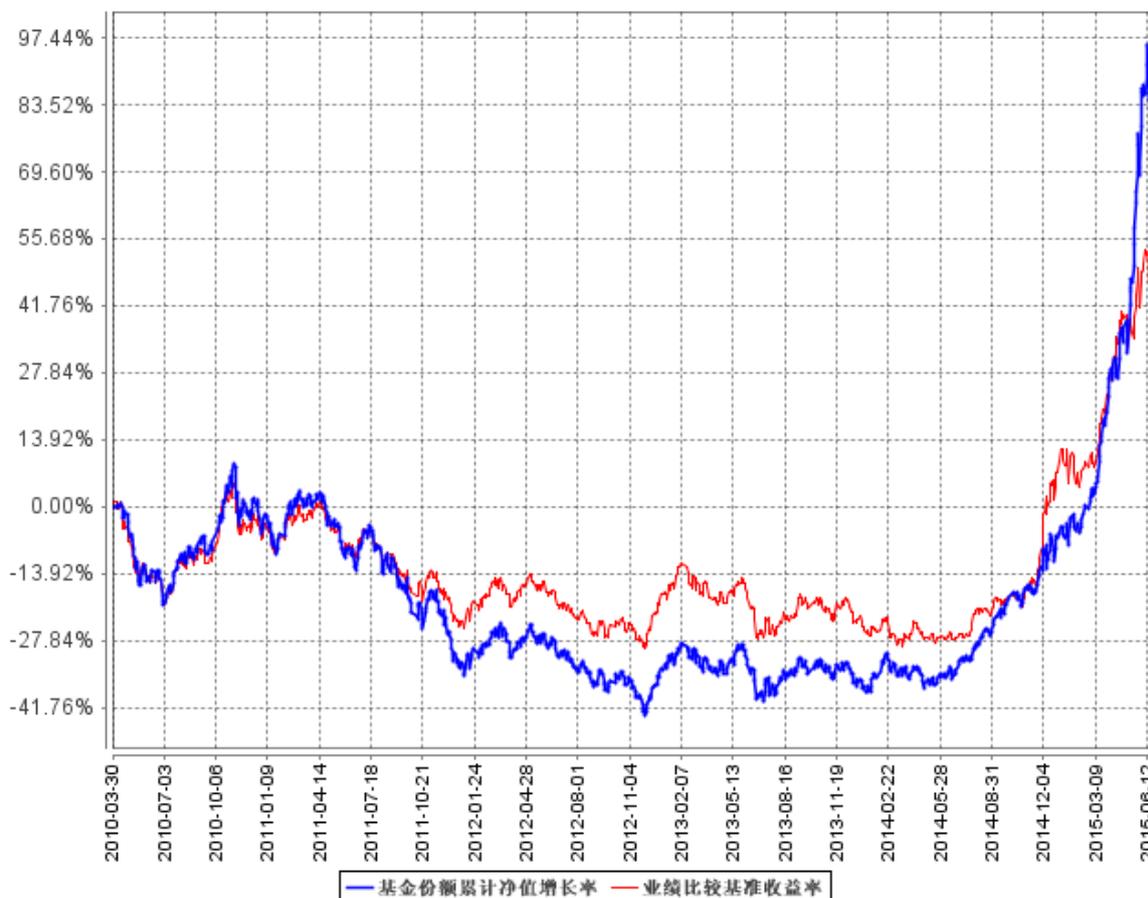
## 3.2 基金净值表现

### 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      | -9.92%   | 3.45%       | -5.84%     | 2.80%         | -4.08% | 0.65% |
| 过去三个月      | 28.04%   | 2.63%       | 8.86%      | 2.09%         | 19.18% | 0.54% |
| 过去六个月      | 62.22%   | 2.07%       | 22.00%     | 1.81%         | 40.22% | 0.26% |
| 过去一年       | 129.03%  | 1.64%       | 81.80%     | 1.47%         | 47.23% | 0.17% |
| 过去三年       | 120.64%  | 1.38%       | 67.10%     | 1.19%         | 53.54% | 0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 53.70%   | 1.36%       | 33.20%     | 1.17%         | 20.50% | 0.19% |

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例达到基金合同的约定。

## §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

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本3亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司一

一南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 3,500 亿元，旗下管理 73 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务      | 任本基金的基金经理期限     |                 | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|---------|-----------------|-----------------|--------|---|
|     |         | 任职日期            | 离任日期            |        |   |
| 杨德龙 | 本基金基金经理 | 2013 年 3 月 15 日 | -               | 8 年    | 北京大学经济学硕士、清华大学工学学士，具有基金从业资格。2006 年加入南方基金，担任研究部高级行业研究员、首席策略分析师；2010 年 8 月至 2013 年 4 月，任小康 ETF 及南方小康基金经理；2011 年 9 月至今，任南方上证 380ETF 及联接基金基金经理；2013 年 3 月至今，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。  |
| 雷俊  | 本基金基金经理 | 2015 年 6 月 16 日 | -               | 7 年    | 北京大学工学硕士，具有基金从业资格。2008 年 7 月加入南方基金，历任信息技术部投研系统研发员、量化投资部高级研究员；2014 年 12 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 4 月至今，任大数据 100 基金经理；2015 年 6 月至今，任南方国企改革、南方高铁、南方策略优化、大数据 300、南方 500 信息、南方量化成长的基金经理。 |
| 罗文杰 | 本基金基金经理 | 2013 年 5 月 17 日 | 2015 年 6 月 19 日 | 10 年   | 女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金量化投资部基金经理助理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任   |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 4 次，其中 1 次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，3 次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致。

#### 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

报告期内本基金采用量化多因子模型选股，重点集中在具有相对优势的价值和成长股之间进

行投资。上半年本基金充分发挥量化选股的优势，运用多个量化策略投资，分散投资风险和平衡风险暴露，同期在同类基金产品中表现稳健，后续产品运作仍将以量化策略为主，力争获取超越市场表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.507；报告期内，基金份额净值增长率为 62.22%，同期业绩基准增长率为 22.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6 月中旬以来，A 股经历了一次比较大的市场调整，在连续多日大幅调整后，央行六月底宣布降息、降准，不断释放政策利好，市场预计在一段时间调整后将逐渐企稳。同时随着去杠杆化的推进和配资业务不断规范和政策导向，投资者对于风险收益的认知度不断提高，这将有助于股票市场健康平稳发展；另外，居民资产配置的转移长期趋势仍未改变，中长期看仍有机会，下半年基金预计仍维持比较高的持仓比例，重点量化选择一些有基本面支撑的个股和行业，力图为投资者创造更好的超额回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总裁、总裁助理兼权益投资总监、数量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：本基金收益分配应遵循下列原则：每一基金份额享有同等分配权；若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件

的前提下，基金收益分配每年最多 12 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未有收益分配事项。

#### 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

无。

## §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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §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：南方策略优化混合型证券投资基金

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<br>2015年6月30日         | 上年度末<br>2014年12月31日         |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                           |                             |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 71,233,820.19             | 38,610,128.53               |
| 结算备付金           |            | 3,026,068.79              | 4,709,671.57                |
| 存出保证金           |            | 376,360.90                | 98,813.41                   |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 529,987,190.70            | 628,184,912.38              |
| 其中：股票投资         |            | 529,952,316.30            | 627,532,699.28              |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 34,874.40                 | 652,213.10                  |
| 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    | -                         | 13,000,000.00               |
| 应收证券清算款         |            | -                         | 10,103,216.81               |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 12,954.11                 | 11,358.99                   |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 10,797,686.31             | 465,006.91                  |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 615,434,081.00            | 695,183,108.60              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2014年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                         | -                           |
| 应付证券清算款         |            | 2,831.00                  | 4,024,735.75                |
| 应付赎回款           |            | 33,340,191.20             | 3,272,587.42                |
| 应付管理人报酬         |            | 849,665.05                | 895,566.73                  |
| 应付托管费           |            | 141,610.85                | 149,261.12                  |
| 应付销售服务费         |            | -                         | -                           |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 4,642,744.67              | 1,768,557.65                |
| 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    | 401,594.62                | 276,981.96                  |
| 负债合计            |            | 39,378,637.39             | 10,387,690.63               |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 382,254,629.57            | 737,168,481.26              |

|            |          |                |                |
|------------|----------|----------------|----------------|
| 未分配利润      | 6.4.7.10 | 193,800,814.04 | -52,373,063.29 |
| 所有者权益合计    |          | 576,055,443.61 | 684,795,417.97 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 615,434,081.00 | 695,183,108.60 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.507 元，基金份额总额 382,254,629.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

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<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 282,524,335.85                           | 28,249,262.63                                 |
| 1.利息收入                |            | 467,110.96                               | 952,912.09                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 195,458.95                               | 56,734.69                                     |
| 债券利息收入                |            | 1,020.42                                 | 452,626.25                                    |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 270,631.59                               | 443,551.15                                    |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 409,427,432.66                           | 14,758,999.02                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 407,195,677.15                           | 12,430,840.36                                 |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 407,507.25                               | 629.72  |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 1,824,248.26                             | 2,327,528.94                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -127,818,635.27                          | 12,532,849.99                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 448,427.50                               | 4,501.53                                      |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 11,249,228.39                            | 5,476,598.65                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 4,630,700.89                             | 3,377,115.66                                  |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 771,783.59                               | 562,852.62                                    |
| 3. 销售服务费              | 6.4.10.2.3 | -  | -   |
| 4. 交易费用               | 6.4.7.19   | 5,663,416.29                             | 1,344,823.73                                  |
| 5. 利息支出               |            | -  | -   |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |            | -  | -   |
| 6. 其他费用               | 6.4.7.20   | 183,327.62                               | 191,806.64                                    |

|                     |  |                |               |
|---------------------|--|----------------|---------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |  | 271,275,107.46 | 22,772,663.98 |
| 减：所得税费用             |  | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |  | 271,275,107.46 | 22,772,663.98 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方策略优化混合型证券投资基金

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<br>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）                        | 737,168,481.26                             | -52,373,063.29  | 684,795,417.97  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 271,275,107.46  | 271,275,107.46  |
| 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）      | -354,913,851.69                            | -25,101,230.13  | -380,015,081.82 |
| 其中：1.基金申购款                             | 252,112,818.25                             | 116,097,095.88  | 368,209,914.13  |
| 2.基金赎回款                                | -607,026,669.94                            | -141,198,326.01 | -748,224,995.95 |
| 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）                        | 382,254,629.57                             | 193,800,814.04  | 576,055,443.61  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 774,110,911.69                             | -289,244,895.93 | 484,866,015.76  |
| 二、本期经营活动产生                             | -  | 22,772,663.98   | 22,772,663.98   |

|  |                 |                 |                |
|--|-----------------|-----------------|----------------|
| 的基金净值变动数（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）      | -107,492,872.31 | 38,265,656.16   | -69,227,216.15 |
| 其中：1.基金申购款                             | 12,853,712.87   | -4,614,789.91   | 8,238,922.96   |
| 2.基金赎回款                                | -120,346,585.18 | 42,880,446.07   | -77,466,139.11 |
| 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）                        | 666,618,039.38  | -228,206,575.79 | 438,411,463.59 |

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：

          杨小松  徐超  徐超            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 6.4.1.3 差错更正的说明

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.2 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时代扣代缴个人所得税，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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2015年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 71,233,820.19     |
| 定期存款         | -                 |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                 |
| 其他存款         | -                 |
| 合计：          | 71,233,820.19     |

#### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2015年6月30日 |                |               |
|---------------|-------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 539,855,509.89    | 529,952,316.30 | -9,903,193.59 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场             | 34,874.40      | 10,874.40     |
|               | 银行间市场             | -              | -             |

|        |    |                |                |               |
|--------|----|----------------|----------------|---------------|
|        | 合计 | 24,000.00      | 34,874.40      | 10,874.40     |
| 资产支持证券 |    | -              | -              | -             |
| 基金     |    | -              | -              | -             |
| 其他     |    | -              | -              | -             |
|        | 合计 | 539,879,509.89 | 529,987,190.70 | -9,892,319.19 |

#### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.3.4 买入返售金融资产

##### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.3.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 11,421.01         |
| 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  | 1,361.70          |
| 应收债券利息     | 2.00              |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 169.40            |
| 合计         | 12,954.11         |

#### 6.4.3.6 其他资产

注：无。

#### 6.4.3.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 4,642,744.67      |

|             |              |
|-------------|--------------|
| 银行间市场应付交易费用 | -            |
| 合计          | 4,642,744.67 |

#### 6.4.3.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 125,554.02        |
| 预提费用        | 276,040.60        |
| 合计          | 401,594.62        |

#### 6.4.3.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 737,168,481.26             | 737,168,481.26  |
| 本期申购          | 252,112,818.25             | 252,112,818.25  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -607,026,669.94            | -607,026,669.94 |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                          | -               |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | -                          | -               |
| 本期申购          | -                          | -               |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -                          | -               |
| 本期末           | 382,254,629.57             | 382,254,629.57  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.3.10 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           | -131,458,890.12 | 79,085,826.83   | -52,373,063.29  |
| 本期利润           | 399,093,742.73  | -127,818,635.27 | 271,275,107.46  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -16,534,941.59  | -8,566,288.54   | -25,101,230.13  |
| 其中：基金申购款       | 82,644,200.11   | 33,452,895.77   | 116,097,095.88  |
| 基金赎回款          | -99,179,141.70  | -42,019,184.31  | -141,198,326.01 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |

|     |                |                |                |
|-----|----------------|----------------|----------------|
| 本期末 | 251,099,911.02 | -57,299,096.98 | 193,800,814.04 |
|-----|----------------|----------------|----------------|

#### 6.4.3.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 159,535.14                 |
| 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 | 33,002.57                  |
| 其他        | 2,921.24                   |
| 合计        | 195,458.95                 |

#### 6.4.3.12 股票投资收益

##### 6.4.3.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,003,419,783.97           |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,596,224,106.82           |
| 买卖股票差价收入   | 407,195,677.15             |

#### 6.4.3.13 债券投资收益

##### 6.4.3.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 910,945.50                 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 502,000.00                 |
| 减：应收利息总额               | 1,438.25                   |
| 买卖债券差价收入               | 407,507.25                 |

##### 6.4.3.13.2 资产支持证券投资收益

注：无。

**6.4.3.14 股利收益**

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,824,248.26                          |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 1,824,248.26                          |

**6.4.3.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -127,818,635.27                       |
| ——股票投资     | -127,679,296.57                       |
| ——债券投资     | -139,338.70                           |
| ——资产支持证券投资 | -                                     |
| ——贵金属投资    | -                                     |
| ——其他       | -                                     |
| 2. 衍生工具    | -                                     |
| ——权证投资     | -                                     |
| 3. 其他      | -                                     |
| 合计         | -127,818,635.27                       |

**6.4.3.16 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 373,860.10                            |
| 转换费     | 74,567.40                             |
| 合计      | 448,427.50                            |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**6.4.3.17 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,663,416.29                          |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 合计        | 5,663,416.29                          |

### 6.4.3.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------|---------------------------------------|
| 审计费用  | 27,273.08                             |
| 信息披露费 | 148,767.52                            |
| 银行汇划费 | 7,287.02                              |
| 合计    | 183,327.62                            |

### 6.4.3.19 分部报告

无。

## 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.4.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

基金管理人于 2015 年 8 月 7 日发布公告，根据 2014 年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条 “（一）百分之八十以上的基金资产投资于股票的为股票基金”的规定，本基金的基金股票投资比例下限低于百分之八十，不再符合有关股票型基金的股票投资比例规定。基金管理人经与托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定不改变本基金的投资范围、投资组合比例，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条 “（五）投资于股票、债券、货币市场工具或其他基金份额，并且股票投资、债券投资、基金投资的比例不符合第（一）项、第（二）项、第（四）项规定的，为混合基金”的规定，自即日起将本基金的类别变更为混合型基金，并相应修改基金合同和托管协议相关条款。

## 6.4.5 关联方关系

### 6.4.5.1 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。

### 6.4.5.2 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             |
|----------------------|---------------------|
| 南方基金管理有限公司（“南方基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）   | 基金管理人的股东、基金销售机构     |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 华泰证券  | 566,990,218.34             | 15.62%               | 266,051,725.24                  | 30.81%               |

#### 6.4.6.1.2 权证交易

注：无。

#### 6.4.6.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日      |                |          |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 华泰证券  | 501,737.29                      | 15.45%         | -        | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                |          |                  |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣<br>金总额的比例 |
| 华泰证券  | 235,432.46                      | 30.48%         | -        | -                |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2015年1月1日至2015年 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|----|-----------------------|---------------------------------|
|----|-----------------------|---------------------------------|

|                 | 6 月 30 日     |              |
|-----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,630,700.89 | 3,377,115.66 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,291,542.98 | 1,046,740.64 |

注：支付基金管理人南方基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 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 | 771,783.59           | 562,852.62           |

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 6.4.6.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.6.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.6.4.2 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

注：无。

#### 6.4.6.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                   |            | 上年度可比期间              |           |
|-------|----------------------|------------|----------------------|-----------|
|       | 2015年1月1日至2015年6月30日 |            | 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    |
| 招商银行  | 71,233,820.19        | 159,535.14 | 2,997,888.37         | 27,000.25 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.6.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日      |        |      |      |           |            |
|---------------------------------|--------|------|------|-----------|------------|
| 关联方名称                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |            |
|                                 |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
|                                 |        |      |      |           |            |
| 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |        |      |      |           |            |
| 关联方名称                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |            |
|                                 |        |      |      | 数量（单位：份）  | 总金额        |
| 兴业证券                            | 002089 | 新海宜  | 配股   | 124,819   | 450,596.59 |

#### 6.4.6.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.7 利润分配情况

##### 6.4.7.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：无。

#### 6.4.8 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 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（股）   | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|------------|------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 002374 | 丽鹏股份 | 2015年6月30日 | 重大事项 | 23.34  | 2015年7月13日 | 22.50  | 121,600 | 3,414,305.98 | 2,838,144.00 | -  |
| 002530 | 丰东股份 | 2015年6月8日  | 重大事项 | 23.71  | -          | -      | 112,800 | 1,554,532.00 | 2,674,488.00 | -  |
| 600167 | 联美控股 | 2015年5月    | 重大事项 | 25.76  | -          | -      | 97,327  | 1,884,963.28 | 2,507,143.52 | -  |

|        |      |                 |          |       |                 |       |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
|        |      | 27 日            |          |       |                 |       |         |              |              |   |
| 300008 | 上海佳豪 | 2015 年 3 月 24 日 | 重大<br>事项 | 17.24 | -               | -     | 143,655 | 1,816,670.03 | 2,476,612.20 | - |
| 300346 | 南大光电 | 2015 年 6 月 25 日 | 重大<br>事项 | 35.49 | -               | -     | 68,580  | 2,139,124.79 | 2,433,904.20 | - |
| 002703 | 浙江世宝 | 2015 年 5 月 29 日 | 重大<br>事项 | 52.01 | -               | -     | 44,910  | 1,478,612.38 | 2,335,769.10 | - |
| 000766 | 通化金马 | 2015 年 3 月 20 日 | 重大<br>事项 | 8.47  | -               | -     | 267,410 | 1,842,558.37 | 2,264,962.70 | - |
| 002003 | 伟星股份 | 2015 年 6 月 5 日  | 重大<br>事项 | 16.17 | -               | -     | 139,512 | 1,795,504.10 | 2,255,909.04 | - |
| 002075 | 沙钢股份 | 2015 年 6 月 25 日 | 重大<br>事项 | 33.00 | -               | -     | 63,500  | 1,709,004.00 | 2,095,500.00 | - |
| 300249 | 依米康  | 2015 年 5 月 29 日 | 重大<br>事项 | 35.00 | -               | -     | 56,000  | 1,170,888.18 | 1,960,000.00 | - |
| 000679 | 大连友谊 | 2015 年 5 月 28 日 | 重大<br>事项 | 16.48 | -               | -     | 116,323 | 1,194,457.63 | 1,917,003.04 | - |
| 002183 | 怡亚通  | 2015 年 6 月 1 日  | 重大<br>事项 | 73.15 | -               | -     | 24,400  | 911,622.58   | 1,784,860.00 | - |
| 300084 | 海默科技 | 2015 年 6 月 3 日  | 重大<br>事项 | 21.43 | 2015 年 7 月 20 日 | 19.29 | 82,060  | 1,514,226.46 | 1,758,545.80 | - |
| 300190 | 维尔利  | 2015 年 5 月      | 重大<br>事项 | 34.34 | -               | -     | 51,200  | 1,238,676.96 | 1,758,208.00 | - |

|        |      |                 |          |       |                 |       |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
|        |      | 25 日            |          |       |                 |       |         |              |              |   |
| 601111 | 中国国航 | 2015 年 6 月 30 日 | 重大<br>事项 | 15.36 | 2015 年 7 月 29 日 | 13.78 | 111,400 | 1,321,567.96 | 1,711,104.00 | - |
| 000668 | 荣丰控股 | 2015 年 5 月 25 日 | 重大<br>事项 | 34.79 | -               | -     | 45,349  | 881,136.31   | 1,577,691.71 | - |
| 000567 | 海德股份 | 2015 年 6 月 17 日 | 重大<br>事项 | 33.71 | 2015 年 8 月 6 日  | 30.34 | 45,700  | 1,426,308.00 | 1,540,547.00 | - |
| 300214 | 日科化学 | 2015 年 5 月 18 日 | 重大<br>事项 | 10.09 | 2015 年 7 月 22 日 | 9.22  | 150,500 | 1,326,527.00 | 1,518,545.00 | - |
| 000720 | 新能泰山 | 2015 年 6 月 12 日 | 重大<br>事项 | 17.01 | -               | -     | 88,500  | 838,368.67   | 1,505,385.00 | - |
| 600393 | 东华实业 | 2015 年 6 月 18 日 | 重大<br>事项 | 17.61 | 2015 年 7 月 1 日  | 15.85 | 78,500  | 851,395.54   | 1,382,385.00 | - |
| 000839 | 中信国安 | 2015 年 6 月 29 日 | 重大<br>事项 | 23.57 | -               | -     | 57,800  | 1,085,337.78 | 1,362,346.00 | - |
| 002209 | 达意隆  | 2015 年 6 月 8 日  | 重大<br>事项 | 26.54 | 2015 年 7 月 13 日 | 23.89 | 49,000  | 1,339,915.00 | 1,300,460.00 | - |
| 000707 | 双环科技 | 2015 年 6 月 9 日  | 重大<br>事项 | 11.61 | -               | -     | 111,200 | 868,957.46   | 1,291,032.00 | - |
| 002671 | 龙泉股份 | 2015 年 6 月 17 日 | 重大<br>事项 | 23.89 | -               | -     | 52,600  | 882,765.00   | 1,256,614.00 | - |
| 600310 | 桂东电力 | 2015 年 6 月      | 重大<br>事项 | 31.53 | 2015 年 7 月      | 34.68 | 39,700  | 1,669,162.00 | 1,251,741.00 | - |

|        |      |                 |          |       |                 |       |        |            |              |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|--------|------------|--------------|---|
|        |      | 30 日            |          |       | 13 日            |       |        |            |              |   |
| 002591 | 恒大高新 | 2015 年 6 月 24 日 | 重大<br>事项 | 19.95 | 2015 年 7 月 17 日 | 17.96 | 62,400 | 805,360.88 | 1,244,880.00 | - |
| 600075 | 新疆天业 | 2015 年 6 月 4 日  | 重大<br>事项 | 16.00 | -               | -     | 74,800 | 735,192.00 | 1,196,800.00 | - |
| 002336 | 人人乐  | 2015 年 6 月 9 日  | 重大<br>事项 | 25.53 | 2015 年 8 月 6 日  | 22.98 | 45,300 | 760,292.00 | 1,156,509.00 | - |
| 002329 | 皇氏集团 | 2015 年 6 月 12 日 | 重大<br>事项 | 69.48 | 2015 年 8 月 13 日 | 62.53 | 16,500 | 582,973.38 | 1,146,420.00 | - |
| 600113 | 浙江东日 | 2015 年 6 月 16 日 | 重大<br>事项 | 18.08 | 2015 年 7 月 8 日  | 16.27 | 62,400 | 892,280.00 | 1,128,192.00 | - |
| 600355 | 精伦电子 | 2015 年 6 月 29 日 | 重大<br>事项 | 20.71 | -               | -     | 53,600 | 884,148.23 | 1,110,056.00 | - |
| 000035 | 中国天楹 | 2015 年 6 月 17 日 | 重大<br>事项 | 23.43 | 2015 年 7 月 17 日 | 21.09 | 46,900 | 888,998.98 | 1,098,867.00 | - |
| 002045 | 国光电器 | 2015 年 6 月 1 日  | 重大<br>事项 | 13.92 | 2015 年 7 月 14 日 | 12.53 | 78,500 | 767,986.78 | 1,092,720.00 | - |
| 002043 | 兔宝宝  | 2015 年 6 月 1 日  | 重大<br>事项 | 12.84 | -               | -     | 83,750 | 578,857.43 | 1,075,350.00 | - |
| 002239 | 金飞达  | 2015 年 5 月 25 日 | 重大<br>事项 | 18.33 | -               | -     | 58,300 | 779,418.00 | 1,068,639.00 | - |
| 002398 | 建研集团 | 2015 年 6 月      | 重大<br>事项 | 28.49 | 2015 年 7 月      | 25.64 | 36,485 | 776,805.78 | 1,039,457.65 | - |

|        |          |                           |          |       |                         |       |        |              |              |   |
|--------|----------|---------------------------|----------|-------|-------------------------|-------|--------|--------------|--------------|---|
|        |          | 8 日                       |          |       | 1 日                     |       |        |              |              |   |
| 000545 | 金浦<br>钛业 | 2015<br>年<br>5 月<br>18 日  | 重大<br>事项 | 21.34 | -                       | -     | 47,600 | 757,014.46   | 1,015,784.00 | - |
| 002012 | 凯恩<br>股份 | 2015<br>年<br>5 月<br>28 日  | 重大<br>事项 | 14.00 | 2015<br>年<br>7 月<br>1 日 | 12.60 | 72,022 | 742,236.64   | 1,008,308.00 | - |
| 002377 | 国创<br>高新 | 2015<br>年<br>6 月<br>26 日  | 重大<br>事项 | 13.32 | 2015<br>年<br>7 月<br>3 日 | 11.99 | 73,920 | 758,284.91   | 984,614.40   | - |
| 002558 | 世纪<br>游轮 | 2014<br>年<br>10 月<br>27 日 | 重大<br>事项 | 31.65 | -                       | -     | 31,002 | 835,907.07   | 981,213.30   | - |
| 002639 | 雪人<br>股份 | 2015<br>年<br>6 月<br>30 日  | 重大<br>事项 | 38.30 | -                       | -     | 25,490 | 823,089.13   | 976,267.00   | - |
| 300184 | 力源<br>信息 | 2015<br>年<br>6 月<br>8 日   | 重大<br>事项 | 25.94 | -                       | -     | 37,100 | 517,093.05   | 962,374.00   | - |
| 300135 | 宝利<br>国际 | 2015<br>年<br>6 月<br>29 日  | 重大<br>事项 | 12.65 | -                       | -     | 75,760 | 929,133.00   | 958,364.00   | - |
| 300116 | 坚瑞<br>消防 | 2015<br>年<br>6 月<br>23 日  | 重大<br>事项 | 15.62 | 2015<br>年<br>7 月<br>3 日 | 9.36  | 59,500 | 1,118,705.00 | 929,390.00   | - |
| 300113 | 顺网<br>科技 | 2015<br>年<br>5 月<br>5 日   | 重大<br>事项 | 57.70 | 2015<br>年<br>8 月<br>6 日 | 51.93 | 15,000 | 933,015.69   | 865,500.00   | - |
| 300196 | 长海<br>股份 | 2015<br>年<br>5 月<br>18 日  | 重大<br>事项 | 35.41 | -                       | -     | 23,200 | 747,363.00   | 821,512.00   | - |
| 300030 | 阳普<br>医疗 | 2015<br>年<br>6 月          | 重大<br>事项 | 27.34 | 2015<br>年<br>7 月        | 24.61 | 29,500 | 782,620.00   | 806,530.00   | - |

|        |      |                 |          |       |                 |       |        |            |            |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|--------|------------|------------|---|
|        |      | 25 日            |          |       | 2 日             |       |        |            |            |   |
| 600099 | 林海股份 | 2015 年 4 月 15 日 | 重大<br>事项 | 13.37 | -               | -     | 57,690 | 805,189.41 | 771,315.30 | - |
| 000592 | 平潭发展 | 2015 年 6 月 30 日 | 重大<br>事项 | 29.76 | 2015 年 7 月 14 日 | 30.00 | 25,900 | 657,613.25 | 770,784.00 | - |
| 002370 | 亚太药业 | 2015 年 4 月 28 日 | 重大<br>事项 | 24.45 | -               | -     | 31,400 | 695,767.16 | 767,730.00 | - |
| 600807 | 天业股份 | 2015 年 6 月 30 日 | 重大<br>事项 | 21.31 | -               | -     | 35,900 | 734,890.73 | 765,029.00 | - |
| 000607 | 华媒控股 | 2015 年 6 月 29 日 | 重大<br>事项 | 14.56 | 2015 年 7 月 1 日  | 15.16 | 51,200 | 965,474.00 | 745,472.00 | - |
| 300071 | 华谊嘉信 | 2015 年 5 月 21 日 | 重大<br>事项 | 13.66 | -               | -     | 54,000 | 690,030.35 | 737,640.00 | - |
| 600053 | 中江地产 | 2015 年 3 月 23 日 | 重大<br>事项 | 13.14 | -               | -     | 55,500 | 497,677.84 | 729,270.00 | - |
| 300323 | 华灿光电 | 2015 年 4 月 29 日 | 重大<br>事项 | 9.38  | -               | -     | 75,476 | 547,127.85 | 707,964.88 | - |
| 002545 | 东方铁塔 | 2015 年 5 月 19 日 | 重大<br>事项 | 26.79 | -               | -     | 25,300 | 573,283.00 | 677,787.00 | - |
| 002272 | 川润股份 | 2015 年 4 月 20 日 | 重大<br>事项 | 11.20 | -               | -     | 60,300 | 598,477.96 | 675,360.00 | - |
| 000813 | 天山纺织 | 2015 年 5 月      | 重大<br>事项 | 11.25 | -               | -     | 58,300 | 651,469.13 | 655,875.00 | - |

|        |      |                 |          |       |                 |       |         |            |            |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|---------|------------|------------|---|
|        |      | 4 日             |          |       |                 |       |         |            |            |   |
| 600246 | 万通地产 | 2015 年 1 月 6 日  | 重大<br>事项 | 5.32  | 2015 年 7 月 6 日  | 5.85  | 118,860 | 498,496.53 | 632,335.20 | - |
| 600869 | 智慧能源 | 2015 年 5 月 11 日 | 重大<br>事项 | 29.14 | 2015 年 7 月 31 日 | 26.23 | 19,400  | 512,113.00 | 565,316.00 | - |
| 000416 | 民生控股 | 2015 年 5 月 29 日 | 重大<br>事项 | 17.52 | -               | -     | 27,200  | 332,746.67 | 476,544.00 | - |
| 002577 | 雷柏科技 | 2015 年 6 月 10 日 | 重大<br>事项 | 80.60 | -               | -     | 5,310   | 318,334.14 | 427,986.00 | - |
| 000850 | 华茂股份 | 2015 年 5 月 7 日  | 重大<br>事项 | 10.98 | -               | -     | 37,900  | 424,127.00 | 416,142.00 | - |
| 000748 | 长城信息 | 2015 年 6 月 18 日 | 重大<br>事项 | 34.88 | -               | -     | 11,500  | 300,176.61 | 401,120.00 | - |
| 601633 | 长城汽车 | 2015 年 6 月 19 日 | 重大<br>事项 | 42.76 | 2015 年 7 月 13 日 | 38.50 | 7,700   | 384,025.28 | 329,252.00 | - |
| 300297 | 蓝盾股份 | 2015 年 4 月 30 日 | 重大<br>事项 | 31.99 | 2015 年 7 月 20 日 | 33.00 | 9,900   | 310,071.60 | 316,701.00 | - |
| 000878 | 云南铜业 | 2015 年 6 月 8 日  | 重大<br>事项 | 24.50 | -               | -     | 12,700  | 222,929.93 | 311,150.00 | - |
| 600879 | 航天电子 | 2015 年 5 月 15 日 | 重大<br>事项 | 24.50 | -               | -     | 12,400  | 236,376.75 | 303,800.00 | - |
| 300291 | 华录百纳 | 2015 年 6 月      | 重大<br>事项 | 37.76 | 2015 年 7 月      | 34.65 | 7,958   | 246,517.92 | 300,494.08 | - |

|        |      |                 |          |       |                 |       |        |            |            |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|--------|------------|------------|---|
|        |      | 30 日            |          |       | 13 日            |       |        |            |            |   |
| 002020 | 京新药业 | 2015 年 4 月 16 日 | 重大<br>事项 | 27.21 | 2015 年 8 月 10 日 | 26.10 | 9,200  | 239,560.00 | 250,332.00 | - |
| 002292 | 奥飞动漫 | 2015 年 5 月 18 日 | 重大<br>事项 | 37.85 | -               | -     | 5,334  | 149,575.86 | 201,891.90 | - |
| 002649 | 博彦科技 | 2015 年 6 月 1 日  | 重大<br>事项 | 83.81 | -               | -     | 2,400  | 141,109.33 | 201,144.00 | - |
| 000881 | 大连国际 | 2015 年 4 月 22 日 | 重大<br>事项 | 13.15 | -               | -     | 13,600 | 152,369.96 | 178,840.00 | - |
| 002416 | 爱施德  | 2015 年 5 月 5 日  | 重大<br>事项 | 20.67 | 2015 年 7 月 29 日 | 18.60 | 8,300  | 170,079.50 | 171,561.00 | - |
| 002546 | 新联电子 | 2015 年 6 月 17 日 | 重大<br>事项 | 33.16 | 2015 年 7 月 16 日 | 29.84 | 4,100  | 94,628.00  | 135,956.00 | - |
| 002214 | 大立科技 | 2015 年 6 月 15 日 | 重大<br>事项 | 20.90 | -               | -     | 6,200  | 104,901.19 | 129,580.00 | - |
| 002620 | 瑞和股份 | 2015 年 6 月 9 日  | 重大<br>事项 | 58.49 | 2015 年 8 月 13 日 | 52.55 | 1,664  | 49,414.45  | 97,327.36  | - |
| 300158 | 振东制药 | 2015 年 4 月 27 日 | 重大<br>事项 | 18.90 | -               | -     | 5,000  | 96,033.33  | 94,500.00  | - |
| 002289 | 宇顺电子 | 2015 年 6 月 11 日 | 重大<br>事项 | 44.95 | -               | -     | 2,100  | 64,401.80  | 94,395.00  | - |
| 300056 | 三维丝  | 2015 年 6 月      | 重大<br>事项 | 46.55 | -               | -     | 2,000  | 66,428.43  | 93,100.00  | - |

|        |      |                 |      |       |                 |       |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------|-------|-----------------|-------|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 5 日             |      |       |                 |       |       |           |           |   |
| 002199 | 东晶电子 | 2015 年 4 月 20 日 | 重大事项 | 14.92 | -               | -     | 6,200 | 86,075.43 | 92,504.00 | - |
| 002320 | 海峡股份 | 2015 年 6 月 26 日 | 重大事项 | 27.43 | -               | -     | 3,200 | 82,705.00 | 87,776.00 | - |
| 300031 | 宝通带业 | 2015 年 6 月 11 日 | 重大事项 | 22.82 | -               | -     | 3,700 | 48,609.64 | 84,434.00 | - |
| 600097 | 开创国际 | 2015 年 6 月 5 日  | 重大事项 | 30.40 | -               | -     | 2,700 | 66,663.00 | 82,080.00 | - |
| 000665 | 湖北广电 | 2015 年 5 月 25 日 | 重大事项 | 27.90 | -               | -     | 2,800 | 54,206.46 | 78,120.00 | - |
| 002238 | 天威视讯 | 2015 年 6 月 29 日 | 重大事项 | 23.76 | -               | -     | 2,601 | 51,982.36 | 61,799.76 | - |
| 002557 | 洽洽食品 | 2015 年 6 月 29 日 | 重大事项 | 16.38 | -               | -     | 3,600 | 74,945.50 | 58,968.00 | - |
| 002498 | 汉缆股份 | 2015 年 6 月 30 日 | 重大事项 | 20.57 | 2015 年 7 月 20 日 | 22.63 | 2,600 | 38,142.00 | 53,482.00 | - |
| 002309 | 中利科技 | 2015 年 6 月 2 日  | 重大事项 | 33.39 | 2015 年 7 月 21 日 | 30.05 | 1,500 | 46,890.00 | 50,085.00 | - |
| 002464 | 金利科技 | 2015 年 1 月 26 日 | 重大事项 | 16.14 | 2015 年 7 月 28 日 | 17.75 | 2,900 | 50,514.57 | 46,806.00 | - |
| 002662 | 京威股份 | 2015 年 5 月      | 重大事项 | 17.84 | 2015 年 8 月      | 16.06 | 2,600 | 45,500.00 | 46,384.00 | - |

|        |      | 15 日            |          |       | 13 日            |       |        |              |              |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|--------|--------------|--------------|---|
| 002676 | 顺威股份 | 2015 年 4 月 20 日 | 重大<br>事项 | 26.94 | 2015 年 7 月 29 日 | 24.25 | 1,700  | 48,212.00    | 45,798.00    | - |
| 002688 | 金河生物 | 2015 年 6 月 2 日  | 重大<br>事项 | 29.70 | 2015 年 7 月 14 日 | 26.73 | 500    | 13,480.00    | 14,850.00    | - |
| 000862 | 银星能源 | 2015 年 5 月 21 日 | 重大<br>事项 | 11.81 | -               | -     | 1,100  | 11,341.00    | 12,991.00    | - |
| 000024 | 招商地产 | 2015 年 4 月 3 日  | 重大<br>事项 | 36.51 | -               | -     | 67,129 | 1,792,528.47 | 2,450,879.79 | - |
| 000543 | 皖能电力 | 2015 年 6 月 15 日 | 重大<br>事项 | 18.53 | 2015 年 7 月 14 日 | 19.22 | 8,500  | 137,849.13   | 157,505.00   | - |
| 000716 | 黑芝麻  | 2015 年 6 月 8 日  | 重大<br>事项 | 20.98 | 2015 年 8 月 3 日  | 21.32 | 39,097 | 918,399.54   | 820,255.06   | - |
| 000732 | 泰禾集团 | 2015 年 6 月 25 日 | 重大<br>事项 | 30.36 | 2015 年 7 月 2 日  | 22.91 | 29,467 | 946,158.09   | 894,618.12   | - |
| 000786 | 北新建材 | 2015 年 4 月 10 日 | 重大<br>事项 | 19.13 | -               | -     | 19,400 | 212,427.80   | 371,122.00   | - |
| 000793 | 华闻传媒 | 2015 年 5 月 26 日 | 重大<br>事项 | 16.89 | -               | -     | 19,500 | 296,434.88   | 329,355.00   | - |
| 000917 | 电广传媒 | 2015 年 5 月 28 日 | 重大<br>事项 | 30.81 | -               | -     | 11,600 | 317,806.90   | 357,396.00   | - |
| 002002 | 鸿达兴业 | 2015 年 6 月      | 重大<br>事项 | 30.52 | -               | -     | 41,400 | 938,636.72   | 1,263,528.00 | - |

|        |      |                 |          |       |                 |       |         |              |              |   |
|--------|------|-----------------|----------|-------|-----------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
|        |      | 18 日            |          |       |                 |       |         |              |              |   |
| 002264 | 新华都  | 2015 年 3 月 11 日 | 重大<br>事项 | 11.67 | 2015 年 6 月 30 日 | 9.35  | 273,864 | 2,014,907.63 | 3,195,992.88 | - |
| 002268 | 卫神通  | 2015 年 5 月 8 日  | 重大<br>事项 | 80.14 | 2015 年 8 月 4 日  | 76.32 | 5,500   | 437,452.63   | 440,770.00   | - |
| 002308 | 威创股份 | 2015 年 6 月 12 日 | 重大<br>事项 | 23.15 | -               | -     | 7,200   | 127,531.42   | 166,680.00   | - |
| 002388 | 新亚制程 | 2015 年 5 月 20 日 | 重大<br>事项 | 26.74 | -               | -     | 54,300  | 1,142,807.00 | 1,451,982.00 | - |
| 002445 | 中南重工 | 2015 年 6 月 2 日  | 重大<br>事项 | 51.39 | -               | -     | 17,488  | 685,152.07   | 898,708.32   | - |
| 002624 | 完美环球 | 2015 年 3 月 24 日 | 重大<br>事项 | 32.90 | 2015 年 7 月 1 日  | 5.65  | 99,004  | 1,860,287.52 | 3,257,231.60 | - |
| 300028 | 金亚科技 | 2015 年 6 月 10 日 | 重大<br>事项 | 27.00 | -               | -     | 20,800  | 789,364.00   | 561,600.00   | - |
| 300203 | 聚光科技 | 2015 年 4 月 20 日 | 重大<br>事项 | 41.19 | 2015 年 8 月 12 日 | 33.88 | 11,400  | 374,526.00   | 469,566.00   | - |
| 300287 | 飞利信  | 2015 年 6 月 2 日  | 重大<br>事项 | 38.08 | -               | -     | 10,600  | 319,665.61   | 403,648.00   | - |
| 600645 | 中源协和 | 2015 年 4 月 27 日 | 重大<br>事项 | 81.32 | -               | -     | 4,800   | 325,067.52   | 390,336.00   | - |
| 000850 | 华贸股份 | 2015 年 5 月      | 重大<br>事项 | 10.98 | -               | -     | 37,900  | 424,127.00   | 416,142.00   | - |

|        |      |                 |      |       |   |   |       |           |           |   |
|--------|------|-----------------|------|-------|---|---|-------|-----------|-----------|---|
|        |      | 7 日             |      |       |   |   |       |           |           |   |
| 000665 | 湖北广电 | 2015 年 5 月 25 日 | 重大事项 | 27.90 | - | - | 2,800 | 54,206.46 | 78,120.00 | - |

## 6.4.8.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.8.2.1 银行间市场债券正回购

无。

### 6.4.8.2.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.9 金融工具风险及管理

### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 招商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.01%（2014 年 12 月 31 日：0.10%）。

#### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.9.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.9.4 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、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 资产                     |       |       |       |     |    |

|                         |               |      |      |                 |                |
|-------------------------|---------------|------|------|-----------------|----------------|
| 银行存款                    | 71,233,820.19 | -    | -    | -               | 71,233,820.19  |
| 结算备付金                   | 3,026,068.79  | -    | -    | -               | 3,026,068.79   |
| 存出保证金                   | 376,360.90    | -    | -    | -               | 376,360.90     |
| 交易性金融资产                 | 34,874.40     | -    | -    | -529,952,316.30 | 529,987,190.70 |
| 应收利息                    | -             | -    | -    | 12,954.11       | 12,954.11      |
| 应收申购款                   | 618,614.73    | -    | -    | 10,179,071.58   | 10,797,686.31  |
| 资产总计                    | 75,289,739.01 | -    | -    | -540,144,341.99 | 615,434,081.00 |
| 负债                      |               |      |      |                 |                |
| 应付证券清算款                 | -             | -    | -    | 2,831.00        | 2,831.00       |
| 应付赎回款                   | -             | -    | -    | 33,340,191.20   | 33,340,191.20  |
| 应付管理人报酬                 | -             | -    | -    | 849,665.05      | 849,665.05     |
| 应付托管费                   | -             | -    | -    | 141,610.85      | 141,610.85     |
| 应付交易费用                  | -             | -    | -    | 4,642,744.67    | 4,642,744.67   |
| 其他负债                    | -             | -    | -    | 401,594.62      | 401,594.62     |
| 负债总计                    | -             | -    | -    | 39,378,637.39   | 39,378,637.39  |
| 利率敏感度缺口                 | 75,289,739.01 | -    | -    | -500,765,704.60 | 576,055,443.61 |
| 上年度末<br>2014年12月<br>31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息             | 合计             |
| 资产                      |               |      |      |                 |                |
| 银行存款                    | 2,997,888.37  | -    | -    | -               | 2,997,888.37   |
| 结算备付金                   | 2,638,157.66  | -    | -    | -               | 2,638,157.66   |
| 存出保证金                   | 101,507.19    | -    | -    | -               | 101,507.19     |
| 交易性金融资产                 | 20,288,629.40 | -    | -    | -387,142,040.30 | 407,430,669.70 |
| 买入返售金融资产                | 26,000,000.00 | -    | -    | -               | 26,000,000.00  |
| 应收证券清算款                 | -             | -    | -    | 1,004,050.00    | 1,004,050.00   |
| 应收利息                    | -             | -    | -    | 626,770.42      | 626,770.42     |
| 应收申购款                   | 2,000.00      | -    | -    | 23,446.88       | 25,446.88      |
| 资产总计                    | 52,028,182.62 | -    | -    | -388,796,307.60 | 440,824,490.22 |
| 负债                      |               |      |      |                 |                |
| 应付赎回款                   | -             | -    | -    | 1,107,710.89    | 1,107,710.89   |
| 应付管理人报酬                 | -             | -    | -    | 531,891.84      | 531,891.84     |
| 应付托管费                   | -             | -    | -    | 88,648.63       | 88,648.63      |
| 应付交易费用                  | -             | -    | -    | 503,206.89      | 503,206.89     |
| 其他负债                    | -             | -    | -    | 181,568.38      | 181,568.38     |
| 负债总计                    | -             | -    | -    | 2,413,026.63    | 2,413,026.63   |
| 利率敏感度缺口                 | 52,028,182.62 | -    | -    | -386,383,280.97 | 438,411,463.59 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01% (2014 年 12 月 31 日：0.10%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中，股票占基金资产的 60%-95%；债券等固定收益类工具及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 5-40%；权证占基金资产的 0-3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |                       |
|--------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|              | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资 | 529,952,316.30         | 92.00                    | 627,532,699.28           | 91.64                 |
| 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            | 529,952,316.30 | 92.00 | 627,532,699.28 | 91.64 |

#### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

|    |                         |                             |                        |
|----|-------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
| 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：人民币元） |                        |
|    |                         | 本期末（2015 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2014 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 沪深 300 指数上升 5%       | 19,160,000.00               | 19,880,000.00          |
|    | 2. 沪深 300 指数下降 5%       | -19,160,000.00              | -19,880,000.00         |

## §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              | 529,952,316.30 | 86.11        |
|    | 其中：股票             | 529,952,316.30 | 86.11        |
| 2  | 固定收益投资            | 34,874.40      | 0.01         |
|    | 其中：债券             | 34,874.40      | 0.01         |
|    | 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      | 74,259,888.98  | 12.07        |
| 7  | 其他各项资产            | 11,187,001.32  | 1.82         |
| 8  | 合计                | 615,434,081.00 | 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         | 13,875,351.43  | 2.41         |
| B  | 采矿业              | 5,191,230.68   | 0.90         |
| C  | 制造业              | 319,274,419.60 | 55.42        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 28,060,987.58  | 4.31         |
| E  | 建筑业              | 6,167,853.56   | 1.07         |
| F  | 批发和零售业           | 27,963,142.58  | 4.87         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 11,141,138.00  | 1.93         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 98,340.00      | 0.02         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 14,281,380.88  | 2.48         |
| J  | 金融业              | 54,764,955.02  | 9.51         |
| K  | 房地产业             | 27,071,548.68  | 4.70         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 3,888,779.04   | 0.68         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 4,555,099.65   | 0.79         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 8,348,243.36   | 1.45         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 600,512.00     | 0.10         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 6,715,131.91   | 1.17         |
| S  | 综合               | 1,099,755.82   | 0.19         |
|    | 合计               | 529,952,316.30 | 92.00        |

## 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 | 63,427  | 5,197,208.38 | 0.90         |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 478,600 | 4,757,284.00 | 0.83         |
| 3  | 600030 | 中信证券 | 152,860 | 4,113,462.60 | 0.71         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 219,900 | 3,793,275.00 | 0.66 |
| 5  | 600000 | 浦发银行 | 207,800 | 3,524,288.00 | 0.61 |
| 6  | 002569 | 步森股份 | 170,200 | 3,477,186.00 | 0.60 |
| 7  | 002201 | 九鼎新材 | 165,461 | 3,342,312.20 | 0.58 |
| 8  | 600837 | 海通证券 | 151,689 | 3,306,820.20 | 0.57 |
| 9  | 002624 | 完美环球 | 99,004  | 3,257,231.60 | 0.57 |
| 10 | 002264 | 新华都  | 273,864 | 3,195,992.88 | 0.55 |
| 11 | 300106 | 西部牧业 | 111,822 | 2,840,278.80 | 0.49 |
| 12 | 002374 | 丽鹏股份 | 121,600 | 2,838,144.00 | 0.49 |
| 13 | 002530 | 丰东股份 | 112,800 | 2,674,488.00 | 0.46 |
| 14 | 600167 | 联美控股 | 97,327  | 2,507,143.52 | 0.44 |
| 15 | 300008 | 上海佳豪 | 143,655 | 2,476,612.20 | 0.43 |
| 16 | 600419 | 天润乳业 | 69,267  | 2,458,978.50 | 0.43 |
| 17 | 000024 | 招商地产 | 67,129  | 2,450,879.79 | 0.43 |
| 18 | 002258 | 利尔化学 | 84,600  | 2,444,940.00 | 0.42 |
| 19 | 300346 | 南大光电 | 68,580  | 2,433,904.20 | 0.42 |
| 20 | 300258 | 精锻科技 | 156,500 | 2,433,575.00 | 0.42 |
| 21 | 600378 | 天科股份 | 116,802 | 2,413,129.32 | 0.42 |
| 22 | 002703 | 浙江世宝 | 44,910  | 2,335,769.10 | 0.41 |
| 23 | 000766 | 通化金马 | 267,410 | 2,264,962.70 | 0.39 |
| 24 | 002003 | 伟星股份 | 139,512 | 2,255,909.04 | 0.39 |
| 25 | 002120 | 新海股份 | 93,509  | 2,253,566.90 | 0.39 |
| 26 | 601328 | 交通银行 | 271,900 | 2,240,456.00 | 0.39 |
| 27 | 600605 | 汇通能源 | 99,320  | 2,135,380.00 | 0.37 |
| 28 | 000776 | 广发证券 | 92,681  | 2,099,224.65 | 0.36 |
| 29 | 002075 | 沙钢股份 | 63,500  | 2,095,500.00 | 0.36 |
| 30 | 600356 | 恒丰纸业 | 182,308 | 2,056,434.24 | 0.36 |
| 31 | 601988 | 中国银行 | 420,200 | 2,054,778.00 | 0.36 |
| 32 | 600048 | 保利地产 | 178,500 | 2,038,470.00 | 0.35 |
| 33 | 002562 | 兄弟科技 | 103,911 | 2,036,655.60 | 0.35 |
| 34 | 000929 | 兰州黄河 | 93,833  | 2,015,532.84 | 0.35 |
| 35 | 002150 | 通润装备 | 141,900 | 2,009,304.00 | 0.35 |
| 36 | 300249 | 依米康  | 56,000  | 1,960,000.00 | 0.34 |
| 37 | 601818 | 光大银行 | 362,079 | 1,940,743.44 | 0.34 |
| 38 | 000679 | 大连友谊 | 116,323 | 1,917,003.04 | 0.33 |
| 39 | 000757 | 浩物股份 | 147,659 | 1,904,801.10 | 0.33 |
| 40 | 000626 | 如意集团 | 23,600  | 1,880,920.00 | 0.33 |
| 41 | 002077 | 大港股份 | 100,882 | 1,839,078.86 | 0.32 |
| 42 | 002714 | 牧原股份 | 31,223  | 1,834,039.02 | 0.32 |

|    |        |       |         |              |      |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 43 | 601398 | 工商银行  | 344,000 | 1,816,320.00 | 0.32 |
| 44 | 000001 | 平安银行  | 124,481 | 1,809,953.74 | 0.31 |
| 45 | 601288 | 农业银行  | 487,800 | 1,809,738.00 | 0.31 |
| 46 | 002183 | 怡亚通   | 24,400  | 1,784,860.00 | 0.31 |
| 47 | 002698 | 博实股份  | 33,546  | 1,771,228.80 | 0.31 |
| 48 | 000615 | 湖北金环  | 92,000  | 1,770,080.00 | 0.31 |
| 49 | 002102 | 冠福股份  | 129,401 | 1,765,029.64 | 0.31 |
| 50 | 300084 | 海默科技  | 82,060  | 1,758,545.80 | 0.31 |
| 51 | 300190 | 维尔利   | 51,200  | 1,758,208.00 | 0.31 |
| 52 | 601788 | 光大证券  | 65,200  | 1,757,140.00 | 0.31 |
| 53 | 300109 | 新开源   | 24,698  | 1,753,064.04 | 0.30 |
| 54 | 000725 | 京东方 A | 336,500 | 1,746,435.00 | 0.30 |
| 55 | 601989 | 中国重工  | 117,400 | 1,737,520.00 | 0.30 |
| 56 | 601601 | 中国太保  | 57,066  | 1,722,251.88 | 0.30 |
| 57 | 600883 | 博闻科技  | 108,401 | 1,715,987.83 | 0.30 |
| 58 | 601111 | 中国国航  | 111,400 | 1,711,104.00 | 0.30 |
| 59 | 300313 | 天山生物  | 75,050  | 1,704,385.50 | 0.30 |
| 60 | 002324 | 普利特   | 49,000  | 1,700,300.00 | 0.30 |
| 61 | 300233 | 金城医药  | 22,500  | 1,684,350.00 | 0.29 |
| 62 | 300230 | 永利带业  | 88,500  | 1,653,180.00 | 0.29 |
| 63 | 600116 | 三峡水利  | 93,000  | 1,650,750.00 | 0.29 |
| 64 | 601628 | 中国人寿  | 52,313  | 1,638,443.16 | 0.28 |
| 65 | 002160 | 常铝股份  | 122,400 | 1,636,488.00 | 0.28 |
| 66 | 002014 | 永新股份  | 67,400  | 1,632,428.00 | 0.28 |
| 67 | 002225 | 濮耐股份  | 171,500 | 1,622,390.00 | 0.28 |
| 68 | 000593 | 大通燃气  | 124,700 | 1,619,853.00 | 0.28 |
| 69 | 600733 | S 前锋  | 23,201  | 1,617,109.70 | 0.28 |
| 70 | 002096 | 南岭民爆  | 48,800  | 1,605,520.00 | 0.28 |
| 71 | 002087 | 新野纺织  | 186,400 | 1,582,536.00 | 0.27 |
| 72 | 000668 | 荣丰控股  | 45,349  | 1,577,691.71 | 0.27 |
| 73 | 002171 | 精诚铜业  | 70,317  | 1,548,380.34 | 0.27 |
| 74 | 300321 | 同大股份  | 15,750  | 1,547,752.50 | 0.27 |
| 75 | 000567 | 海德股份  | 45,700  | 1,540,547.00 | 0.27 |
| 76 | 000039 | 中集集团  | 47,300  | 1,527,790.00 | 0.27 |
| 77 | 300117 | 嘉寓股份  | 139,015 | 1,523,604.40 | 0.26 |
| 78 | 300259 | 新天科技  | 100,900 | 1,523,590.00 | 0.26 |
| 79 | 300214 | 日科化学  | 150,500 | 1,518,545.00 | 0.26 |
| 80 | 300308 | 中际装备  | 69,300  | 1,508,661.00 | 0.26 |
| 81 | 000720 | 新能泰山  | 88,500  | 1,505,385.00 | 0.26 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 82  | 002451 | 摩恩电气 | 95,500  | 1,493,620.00 | 0.26 |
| 83  | 000985 | 大庆华科 | 57,965  | 1,492,019.10 | 0.26 |
| 84  | 002291 | 星期六  | 86,911  | 1,490,523.65 | 0.26 |
| 85  | 002627 | 宜昌交运 | 50,800  | 1,484,884.00 | 0.26 |
| 86  | 002361 | 神剑股份 | 80,100  | 1,481,049.00 | 0.26 |
| 87  | 601006 | 大秦铁路 | 104,900 | 1,472,796.00 | 0.26 |
| 88  | 300174 | 元力股份 | 53,800  | 1,469,816.00 | 0.26 |
| 89  | 000885 | 同力水泥 | 86,459  | 1,452,511.20 | 0.25 |
| 90  | 002388 | 新亚制程 | 54,300  | 1,451,982.00 | 0.25 |
| 91  | 000756 | 新华制药 | 119,400 | 1,443,546.00 | 0.25 |
| 92  | 300129 | 泰胜风能 | 157,700 | 1,435,070.00 | 0.25 |
| 93  | 600649 | 城投控股 | 153,400 | 1,434,290.00 | 0.25 |
| 94  | 002494 | 华斯股份 | 64,000  | 1,432,320.00 | 0.25 |
| 95  | 300186 | 大华农  | 32,400  | 1,412,640.00 | 0.25 |
| 96  | 600393 | 东华实业 | 78,500  | 1,382,385.00 | 0.24 |
| 97  | 600671 | 天目药业 | 50,929  | 1,371,517.97 | 0.24 |
| 98  | 300342 | 天银机电 | 37,400  | 1,370,710.00 | 0.24 |
| 99  | 000839 | 中信国安 | 57,800  | 1,362,346.00 | 0.24 |
| 100 | 002619 | 巨龙管业 | 42,900  | 1,355,640.00 | 0.24 |
| 101 | 002265 | 西仪股份 | 74,151  | 1,349,548.20 | 0.23 |
| 102 | 600178 | 东安动力 | 111,400 | 1,341,256.00 | 0.23 |
| 103 | 300306 | 远方光电 | 47,300  | 1,331,022.00 | 0.23 |
| 104 | 300260 | 新莱应材 | 39,204  | 1,328,231.52 | 0.23 |
| 105 | 002695 | 煌上煌  | 30,500  | 1,319,430.00 | 0.23 |
| 106 | 002032 | 苏泊尔  | 53,600  | 1,319,096.00 | 0.23 |
| 107 | 002644 | 佛慈制药 | 26,200  | 1,309,476.00 | 0.23 |
| 108 | 300283 | 温州宏丰 | 94,188  | 1,306,387.56 | 0.23 |
| 109 | 000953 | 河池化工 | 105,560 | 1,304,721.60 | 0.23 |
| 110 | 002209 | 达意隆  | 49,000  | 1,300,460.00 | 0.23 |
| 111 | 000707 | 双环科技 | 111,200 | 1,291,032.00 | 0.22 |
| 112 | 600359 | 新农开发 | 66,800  | 1,288,572.00 | 0.22 |
| 113 | 002247 | 帝龙新材 | 49,000  | 1,283,800.00 | 0.22 |
| 114 | 300275 | 梅安森  | 42,900  | 1,268,982.00 | 0.22 |
| 115 | 002002 | 鸿达兴业 | 41,400  | 1,263,528.00 | 0.22 |
| 116 | 600104 | 上汽集团 | 55,849  | 1,262,187.40 | 0.22 |
| 117 | 002671 | 龙泉股份 | 52,600  | 1,256,614.00 | 0.22 |
| 118 | 600310 | 桂东电力 | 39,700  | 1,251,741.00 | 0.22 |
| 119 | 600182 | S 佳通 | 50,400  | 1,247,904.00 | 0.22 |
| 120 | 002591 | 恒大高新 | 62,400  | 1,244,880.00 | 0.22 |

|     |        |        |         |              |      |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 121 | 600758 | 红阳能源   | 76,884  | 1,243,983.12 | 0.22 |
| 122 | 002634 | 棒杰股份   | 39,000  | 1,236,300.00 | 0.21 |
| 123 | 600593 | 大连圣亚   | 39,200  | 1,217,552.00 | 0.21 |
| 123 | 000736 | 中房地产   | 78,400  | 1,217,552.00 | 0.21 |
| 124 | 300126 | 锐奇股份   | 41,100  | 1,216,149.00 | 0.21 |
| 125 | 300371 | 汇中股份   | 38,500  | 1,200,430.00 | 0.21 |
| 126 | 300206 | 理邦仪器   | 37,420  | 1,198,188.40 | 0.21 |
| 127 | 600075 | 新疆天业   | 74,800  | 1,196,800.00 | 0.21 |
| 128 | 600231 | 凌钢股份   | 145,100 | 1,192,722.00 | 0.21 |
| 129 | 002338 | 奥普光电   | 16,300  | 1,189,900.00 | 0.21 |
| 130 | 000838 | 国兴地产   | 53,800  | 1,185,214.00 | 0.21 |
| 131 | 002131 | 利欧股份   | 20,200  | 1,181,902.00 | 0.21 |
| 132 | 002124 | 天邦股份   | 58,503  | 1,181,760.60 | 0.21 |
| 133 | 002449 | 国星光电   | 53,300  | 1,172,600.00 | 0.20 |
| 134 | 600900 | 长江电力   | 81,700  | 1,172,395.00 | 0.20 |
| 135 | 600015 | 华夏银行   | 76,299  | 1,160,507.79 | 0.20 |
| 136 | 300062 | 中能电气   | 56,712  | 1,159,760.40 | 0.20 |
| 137 | 002336 | 人人乐    | 45,300  | 1,156,509.00 | 0.20 |
| 138 | 601939 | 建设银行   | 162,100 | 1,155,773.00 | 0.20 |
| 139 | 002694 | 顾地科技   | 80,000  | 1,148,800.00 | 0.20 |
| 140 | 002329 | 皇氏集团   | 16,500  | 1,146,420.00 | 0.20 |
| 141 | 000623 | 吉林敖东   | 34,000  | 1,142,400.00 | 0.20 |
| 142 | 600843 | 上工申贝   | 55,100  | 1,139,468.00 | 0.20 |
| 143 | 002621 | 大连三垒   | 59,057  | 1,139,209.53 | 0.20 |
| 144 | 601555 | XD 东吴证 | 55,600  | 1,138,132.00 | 0.20 |
| 145 | 000533 | 万家乐    | 90,700  | 1,132,843.00 | 0.20 |
| 146 | 600113 | 浙江东日   | 62,400  | 1,128,192.00 | 0.20 |
| 147 | 300378 | 鼎捷软件   | 13,739  | 1,114,782.46 | 0.19 |
| 148 | 300023 | 宝德股份   | 33,900  | 1,114,632.00 | 0.19 |
| 149 | 600995 | 文山电力   | 80,240  | 1,114,533.60 | 0.19 |
| 150 | 600369 | 西南证券   | 56,700  | 1,114,155.00 | 0.19 |
| 151 | 600355 | 精伦电子   | 53,600  | 1,110,056.00 | 0.19 |
| 152 | 300140 | 启源装备   | 27,800  | 1,105,884.00 | 0.19 |
| 153 | 000035 | 中国天楹   | 46,900  | 1,098,867.00 | 0.19 |
| 154 | 000692 | 惠天热电   | 113,200 | 1,095,776.00 | 0.19 |
| 155 | 600965 | 福成五丰   | 66,300  | 1,093,950.00 | 0.19 |
| 156 | 002045 | 国光电器   | 78,500  | 1,092,720.00 | 0.19 |
| 157 | 002592 | 八菱科技   | 20,200  | 1,090,396.00 | 0.19 |
| 158 | 000544 | 中原环保   | 46,100  | 1,087,960.00 | 0.19 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 159 | 601113 | 华鼎股份 | 110,900 | 1,084,602.00 | 0.19 |
| 160 | 300354 | 东华测试 | 30,508  | 1,084,254.32 | 0.19 |
| 161 | 002652 | 扬子新材 | 70,100  | 1,083,045.00 | 0.19 |
| 162 | 002654 | 万润科技 | 36,442  | 1,081,234.14 | 0.19 |
| 163 | 600873 | 梅花生物 | 103,400 | 1,079,496.00 | 0.19 |
| 164 | 002043 | 兔宝宝  | 83,750  | 1,075,350.00 | 0.19 |
| 165 | 300317 | 珈伟股份 | 32,200  | 1,074,192.00 | 0.19 |
| 166 | 002537 | 海立美达 | 68,718  | 1,072,687.98 | 0.19 |
| 167 | 300338 | 开元仪器 | 56,400  | 1,072,164.00 | 0.19 |
| 168 | 002239 | 金飞达  | 58,300  | 1,068,639.00 | 0.19 |
| 169 | 600365 | 通葡股份 | 35,600  | 1,065,508.00 | 0.18 |
| 170 | 600281 | 太化股份 | 97,600  | 1,063,840.00 | 0.18 |
| 171 | 600306 | 商业城  | 63,509  | 1,063,140.66 | 0.18 |
| 172 | 002428 | 云南锗业 | 45,100  | 1,060,301.00 | 0.18 |
| 173 | 600999 | 招商证券 | 39,878  | 1,055,171.88 | 0.18 |
| 174 | 300042 | 朗科科技 | 40,171  | 1,054,087.04 | 0.18 |
| 175 | 600503 | 华丽家族 | 60,500  | 1,052,700.00 | 0.18 |
| 176 | 300341 | 麦迪电气 | 34,900  | 1,049,792.00 | 0.18 |
| 177 | 002566 | 益盛药业 | 46,100  | 1,047,853.00 | 0.18 |
| 178 | 000785 | 武汉中商 | 64,900  | 1,041,645.00 | 0.18 |
| 179 | 002398 | 建研集团 | 36,485  | 1,039,457.65 | 0.18 |
| 180 | 300001 | 特锐德  | 50,400  | 1,036,728.00 | 0.18 |
| 181 | 000498 | 山东路桥 | 112,800 | 1,035,504.00 | 0.18 |
| 182 | 600493 | 凤竹纺织 | 66,200  | 1,033,382.00 | 0.18 |
| 183 | 600131 | 岷江水电 | 95,000  | 1,031,700.00 | 0.18 |
| 184 | 002231 | 奥维通信 | 54,500  | 1,031,685.00 | 0.18 |
| 185 | 600273 | 嘉化能源 | 60,300  | 1,031,130.00 | 0.18 |
| 186 | 601608 | 中信重工 | 63,200  | 1,030,160.00 | 0.18 |
| 187 | 002089 | 新海宜  | 43,840  | 1,026,732.80 | 0.18 |
| 188 | 002010 | 传化股份 | 63,700  | 1,024,296.00 | 0.18 |
| 189 | 300268 | 万福生科 | 46,900  | 1,022,889.00 | 0.18 |
| 190 | 000968 | 煤气化  | 81,600  | 1,022,448.00 | 0.18 |
| 191 | 600861 | 北京城乡 | 53,400  | 1,021,008.00 | 0.18 |
| 192 | 600619 | 海立股份 | 70,900  | 1,016,706.00 | 0.18 |
| 193 | 000545 | 金浦钛业 | 47,600  | 1,015,784.00 | 0.18 |
| 194 | 300356 | 光一科技 | 20,000  | 1,012,000.00 | 0.18 |
| 195 | 000404 | 华意压缩 | 88,500  | 1,008,900.00 | 0.18 |
| 196 | 002012 | 凯恩股份 | 72,022  | 1,008,308.00 | 0.18 |
| 197 | 300108 | 双龙股份 | 59,200  | 1,007,584.00 | 0.17 |

|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 198 | 002403 | 爱仕达  | 42,900  | 1,002,144.00 | 0.17 |
| 199 | 002548 | 金新农  | 63,200  | 1,001,720.00 | 0.17 |
| 200 | 600483 | 福能股份 | 56,400  | 1,000,536.00 | 0.17 |
| 201 | 002104 | 恒宝股份 | 42,100  | 997,349.00   | 0.17 |
| 202 | 000096 | 广聚能源 | 53,800  | 992,610.00   | 0.17 |
| 203 | 002713 | 东易日盛 | 29,500  | 991,200.00   | 0.17 |
| 204 | 600279 | 重庆港九 | 61,600  | 988,680.00   | 0.17 |
| 205 | 002222 | 福晶科技 | 50,700  | 988,143.00   | 0.17 |
| 206 | 601137 | 博威合金 | 38,432  | 987,702.40   | 0.17 |
| 207 | 600714 | 金瑞矿业 | 62,804  | 987,278.88   | 0.17 |
| 208 | 002377 | 国创高新 | 73,920  | 984,614.40   | 0.17 |
| 209 | 000048 | 康达尔  | 38,900  | 984,170.00   | 0.17 |
| 210 | 002558 | 世纪游轮 | 31,002  | 981,213.30   | 0.17 |
| 211 | 002639 | 雪人股份 | 25,490  | 976,267.00   | 0.17 |
| 212 | 002426 | 胜利精密 | 44,300  | 974,600.00   | 0.17 |
| 213 | 600540 | 新赛股份 | 72,399  | 974,490.54   | 0.17 |
| 214 | 300137 | 先河环保 | 42,500  | 972,400.00   | 0.17 |
| 215 | 000876 | 新希望  | 49,900  | 968,559.00   | 0.17 |
| 216 | 002340 | 格林美  | 63,580  | 967,051.80   | 0.17 |
| 217 | 600101 | 明星电力 | 72,600  | 964,854.00   | 0.17 |
| 218 | 300041 | 回天新材 | 26,800  | 963,996.00   | 0.17 |
| 219 | 000521 | 美菱电器 | 106,700 | 962,434.00   | 0.17 |
| 220 | 300184 | 力源信息 | 37,100  | 962,374.00   | 0.17 |
| 221 | 002068 | 黑猫股份 | 97,800  | 960,396.00   | 0.17 |
| 222 | 300135 | 宝利沥青 | 75,760  | 958,364.00   | 0.17 |
| 223 | 002219 | 恒康医疗 | 21,500  | 955,890.00   | 0.17 |
| 224 | 601116 | 三江购物 | 68,700  | 955,617.00   | 0.17 |
| 225 | 002599 | 盛通股份 | 25,100  | 955,306.00   | 0.17 |
| 226 | 300237 | 美晨科技 | 29,123  | 954,360.71   | 0.17 |
| 227 | 000005 | 世纪星源 | 103,900 | 953,802.00   | 0.17 |
| 228 | 002129 | 中环股份 | 47,900  | 947,941.00   | 0.16 |
| 229 | 000638 | 万方发展 | 48,000  | 945,600.00   | 0.16 |
| 230 | 002503 | 搜于特  | 50,000  | 944,000.00   | 0.16 |
| 231 | 300211 | 亿通科技 | 45,540  | 941,767.20   | 0.16 |
| 232 | 600810 | 神马股份 | 85,716  | 941,161.68   | 0.16 |
| 233 | 002328 | 新朋股份 | 67,050  | 938,700.00   | 0.16 |
| 234 | 600969 | 郴电国际 | 45,921  | 934,492.35   | 0.16 |
| 235 | 600751 | 天津海运 | 71,200  | 932,008.00   | 0.16 |
| 236 | 600982 | 宁波热电 | 100,600 | 929,544.00   | 0.16 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 237 | 300116 | 坚瑞消防 | 59,500 | 929,390.00 | 0.16 |
| 238 | 000635 | 英力特  | 63,031 | 925,295.08 | 0.16 |
| 239 | 000551 | 创元科技 | 64,086 | 920,915.82 | 0.16 |
| 240 | 002243 | 通产丽星 | 66,480 | 917,424.00 | 0.16 |
| 241 | 600051 | 宁波联合 | 63,100 | 916,843.00 | 0.16 |
| 242 | 600011 | 华能国际 | 65,300 | 916,159.00 | 0.16 |
| 243 | 000040 | 宝安地产 | 61,797 | 913,359.66 | 0.16 |
| 244 | 000042 | 中洲控股 | 37,400 | 912,934.00 | 0.16 |
| 245 | 000505 | 珠江控股 | 63,000 | 901,530.00 | 0.16 |
| 246 | 002492 | 恒基达鑫 | 57,600 | 899,136.00 | 0.16 |
| 247 | 002445 | 中南重工 | 17,488 | 898,708.32 | 0.16 |
| 248 | 002439 | 启明星辰 | 26,100 | 895,230.00 | 0.16 |
| 249 | 000798 | 中水渔业 | 55,701 | 895,115.07 | 0.16 |
| 250 | 000732 | 泰禾集团 | 29,467 | 894,618.12 | 0.16 |
| 251 | 600128 | 弘业股份 | 47,400 | 888,750.00 | 0.15 |
| 252 | 600029 | 南方航空 | 61,100 | 888,394.00 | 0.15 |
| 253 | 300091 | 金通灵  | 22,300 | 887,540.00 | 0.15 |
| 254 | 600615 | 丰华股份 | 38,600 | 887,414.00 | 0.15 |
| 255 | 300219 | 鸿利光电 | 23,280 | 884,174.40 | 0.15 |
| 256 | 000421 | 南京中北 | 78,506 | 883,977.56 | 0.15 |
| 257 | 002321 | 华英农业 | 71,800 | 881,704.00 | 0.15 |
| 258 | 002119 | 康强电子 | 36,500 | 878,920.00 | 0.15 |
| 259 | 600727 | 鲁北化工 | 78,600 | 876,390.00 | 0.15 |
| 260 | 600452 | 涪陵电力 | 34,500 | 875,265.00 | 0.15 |
| 261 | 600697 | 欧亚集团 | 28,200 | 873,636.00 | 0.15 |
| 262 | 002350 | 北京科锐 | 38,000 | 873,240.00 | 0.15 |
| 263 | 002420 | 毅昌股份 | 77,300 | 872,717.00 | 0.15 |
| 264 | 002573 | 国电清新 | 42,200 | 872,274.00 | 0.15 |
| 265 | 600337 | 美克家居 | 58,272 | 870,583.68 | 0.15 |
| 266 | 300113 | 顺网科技 | 15,000 | 865,500.00 | 0.15 |
| 267 | 600421 | 仰帆控股 | 55,300 | 864,339.00 | 0.15 |
| 268 | 600695 | 绿庭投资 | 80,800 | 863,752.00 | 0.15 |
| 269 | 002532 | 新界泵业 | 43,902 | 862,674.30 | 0.15 |
| 270 | 600854 | 春兰股份 | 96,478 | 861,548.54 | 0.15 |
| 271 | 002286 | 保龄宝  | 55,100 | 857,907.00 | 0.15 |
| 272 | 600114 | 东睦股份 | 47,200 | 847,712.00 | 0.15 |
| 273 | 600769 | 祥龙电业 | 70,200 | 846,612.00 | 0.15 |
| 274 | 300296 | 利亚德  | 45,496 | 846,225.60 | 0.15 |
| 275 | 600613 | 神奇制药 | 33,200 | 841,288.00 | 0.15 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 276 | 600109 | 国金证券 | 34,400 | 839,360.00 | 0.15 |
| 277 | 600617 | 国新能源 | 45,900 | 838,593.00 | 0.15 |
| 278 | 601177 | 杭齿前进 | 68,100 | 834,225.00 | 0.14 |
| 279 | 300199 | 翰宇药业 | 25,800 | 834,114.00 | 0.14 |
| 280 | 601233 | 桐昆股份 | 41,700 | 832,332.00 | 0.14 |
| 281 | 600731 | 湖南海利 | 68,496 | 832,226.40 | 0.14 |
| 282 | 002182 | 云海金属 | 53,000 | 831,570.00 | 0.14 |
| 283 | 000822 | 山东海化 | 93,700 | 831,119.00 | 0.14 |
| 284 | 300033 | 同花顺  | 9,600  | 825,504.00 | 0.14 |
| 285 | 002510 | 天汽模  | 54,000 | 823,500.00 | 0.14 |
| 286 | 300274 | 阳光电源 | 26,900 | 822,333.00 | 0.14 |
| 287 | 002692 | 远程电缆 | 38,500 | 821,590.00 | 0.14 |
| 288 | 300196 | 长海股份 | 23,200 | 821,512.00 | 0.14 |
| 289 | 601965 | 中国汽研 | 63,100 | 820,931.00 | 0.14 |
| 290 | 000716 | 黑芝麻  | 39,097 | 820,255.06 | 0.14 |
| 291 | 000713 | 丰乐种业 | 57,600 | 817,920.00 | 0.14 |
| 292 | 603123 | 翠微股份 | 59,900 | 814,640.00 | 0.14 |
| 293 | 002026 | 山东威达 | 63,781 | 810,018.70 | 0.14 |
| 294 | 600218 | 全柴动力 | 56,700 | 809,676.00 | 0.14 |
| 295 | 002059 | 云南旅游 | 66,722 | 809,337.86 | 0.14 |
| 296 | 600283 | 钱江水利 | 47,577 | 808,809.00 | 0.14 |
| 297 | 000702 | 正虹科技 | 64,700 | 808,750.00 | 0.14 |
| 298 | 300030 | 阳普医疗 | 29,500 | 806,530.00 | 0.14 |
| 299 | 600345 | 长江通信 | 36,900 | 805,527.00 | 0.14 |
| 300 | 600176 | 中国巨石 | 29,700 | 803,682.00 | 0.14 |
| 301 | 000908 | 景峰医药 | 43,000 | 800,230.00 | 0.14 |
| 302 | 002452 | 长高集团 | 76,900 | 798,991.00 | 0.14 |
| 303 | 000617 | 石油济柴 | 51,400 | 795,672.00 | 0.14 |
| 304 | 002213 | 特尔佳  | 51,100 | 792,561.00 | 0.14 |
| 305 | 600781 | 辅仁药业 | 32,800 | 786,544.00 | 0.14 |
| 306 | 002623 | 亚玛顿  | 18,000 | 784,800.00 | 0.14 |
| 307 | 000153 | 丰原药业 | 58,800 | 779,100.00 | 0.14 |
| 308 | 600746 | 江苏索普 | 54,300 | 778,119.00 | 0.14 |
| 309 | 300256 | 星星科技 | 34,000 | 777,920.00 | 0.14 |
| 310 | 300181 | 佐力药业 | 65,460 | 776,355.60 | 0.13 |
| 311 | 002035 | 华帝股份 | 48,800 | 773,480.00 | 0.13 |
| 312 | 600693 | 东百集团 | 62,100 | 773,145.00 | 0.13 |
| 313 | 300043 | 互动娱乐 | 51,500 | 773,015.00 | 0.13 |
| 314 | 600099 | 林海股份 | 57,690 | 771,315.30 | 0.13 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 315 | 000592 | 平潭发展  | 25,900 | 770,784.00 | 0.13 |
| 316 | 300267 | 尔康制药  | 22,600 | 770,434.00 | 0.13 |
| 317 | 601336 | 新华保险  | 12,600 | 769,356.00 | 0.13 |
| 318 | 002370 | 亚太药业  | 31,400 | 767,730.00 | 0.13 |
| 319 | 300072 | 三聚环保  | 22,730 | 766,001.00 | 0.13 |
| 320 | 600807 | 天业股份  | 35,900 | 765,029.00 | 0.13 |
| 321 | 002613 | 北玻股份  | 87,250 | 759,075.00 | 0.13 |
| 322 | 300022 | 吉峰农机  | 57,400 | 758,254.00 | 0.13 |
| 323 | 002271 | 东方雨虹  | 29,300 | 753,010.00 | 0.13 |
| 324 | 000731 | 四川美丰  | 56,200 | 752,518.00 | 0.13 |
| 325 | 002064 | 华峰氨纶  | 82,900 | 751,903.00 | 0.13 |
| 326 | 002576 | 通达动力  | 24,900 | 751,731.00 | 0.13 |
| 327 | 002343 | 禾欣股份  | 30,700 | 749,694.00 | 0.13 |
| 328 | 002434 | 万里扬   | 38,400 | 746,112.00 | 0.13 |
| 329 | 000607 | 华媒控股  | 51,200 | 745,472.00 | 0.13 |
| 330 | 002554 | 惠博普   | 51,800 | 744,366.00 | 0.13 |
| 331 | 300200 | 高盟新材  | 47,700 | 741,258.00 | 0.13 |
| 332 | 002538 | 司尔特   | 55,600 | 740,036.00 | 0.13 |
| 333 | 002384 | 东山精密  | 33,400 | 738,474.00 | 0.13 |
| 334 | 000006 | 深振业 A | 54,400 | 738,208.00 | 0.13 |
| 335 | 300071 | 华谊嘉信  | 54,000 | 737,640.00 | 0.13 |
| 336 | 002440 | 闰土股份  | 30,700 | 735,879.00 | 0.13 |
| 337 | 300003 | 乐普医疗  | 18,100 | 734,317.00 | 0.13 |
| 338 | 300262 | 巴安水务  | 39,670 | 733,895.00 | 0.13 |
| 339 | 002689 | 博林特   | 55,780 | 733,507.00 | 0.13 |
| 340 | 600891 | 秋林集团  | 65,700 | 732,555.00 | 0.13 |
| 341 | 600278 | 东方创业  | 36,100 | 730,664.00 | 0.13 |
| 342 | 600053 | 中江地产  | 55,500 | 729,270.00 | 0.13 |
| 343 | 002296 | 辉煌科技  | 34,400 | 726,528.00 | 0.13 |
| 344 | 300179 | 四方达   | 70,150 | 724,649.50 | 0.13 |
| 345 | 600203 | 福日电子  | 45,600 | 720,480.00 | 0.13 |
| 346 | 000758 | 中色股份  | 36,700 | 720,421.00 | 0.13 |
| 347 | 300029 | 天龙光电  | 47,800 | 718,434.00 | 0.12 |
| 348 | 002736 | 国信证券  | 28,600 | 717,574.00 | 0.12 |
| 349 | 300224 | 正海磁材  | 33,977 | 716,574.93 | 0.12 |
| 350 | 002732 | 燕塘乳业  | 21,300 | 712,485.00 | 0.12 |
| 351 | 002300 | 太阳电缆  | 61,600 | 710,864.00 | 0.12 |
| 352 | 300323 | 华灿光电  | 75,476 | 707,964.88 | 0.12 |
| 353 | 002402 | 和而泰   | 24,300 | 707,130.00 | 0.12 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 354 | 002658 | 雪迪龙  | 27,300  | 707,070.00 | 0.12 |
| 355 | 300066 | 三川股份 | 44,763  | 705,912.51 | 0.12 |
| 356 | 600458 | 时代新材 | 28,000  | 702,800.00 | 0.12 |
| 357 | 002333 | 罗普斯金 | 35,600  | 701,676.00 | 0.12 |
| 358 | 600796 | 钱江生化 | 54,400  | 698,496.00 | 0.12 |
| 359 | 002034 | 美欣达  | 17,445  | 697,800.00 | 0.12 |
| 360 | 300019 | 硅宝科技 | 45,810  | 696,312.00 | 0.12 |
| 361 | 002145 | 中核钛白 | 36,400  | 695,968.00 | 0.12 |
| 362 | 002168 | 深圳惠程 | 44,665  | 693,200.80 | 0.12 |
| 363 | 300092 | 科新机电 | 50,200  | 692,760.00 | 0.12 |
| 364 | 300327 | 中颖电子 | 32,490  | 691,062.30 | 0.12 |
| 365 | 002107 | 沃华医药 | 22,800  | 689,244.00 | 0.12 |
| 366 | 002642 | 荣之联  | 12,000  | 685,800.00 | 0.12 |
| 367 | 300014 | 亿纬锂能 | 25,800  | 683,700.00 | 0.12 |
| 368 | 300127 | 银河磁体 | 40,981  | 683,563.08 | 0.12 |
| 369 | 000046 | 泛海控股 | 46,500  | 681,225.00 | 0.12 |
| 370 | 002053 | 云南盐化 | 23,657  | 679,192.47 | 0.12 |
| 371 | 002545 | 东方铁塔 | 25,300  | 677,787.00 | 0.12 |
| 372 | 000029 | 深深房A | 50,200  | 676,194.00 | 0.12 |
| 373 | 002272 | 川润股份 | 60,300  | 675,360.00 | 0.12 |
| 374 | 300153 | 科泰电源 | 53,610  | 674,949.90 | 0.12 |
| 375 | 300171 | 东富龙  | 24,000  | 674,160.00 | 0.12 |
| 376 | 002365 | 永安药业 | 33,038  | 667,367.60 | 0.12 |
| 377 | 002041 | 登海种业 | 37,650  | 666,028.50 | 0.12 |
| 378 | 300382 | 斯莱克  | 12,100  | 660,539.00 | 0.11 |
| 379 | 002690 | 美亚光电 | 16,800  | 659,736.00 | 0.11 |
| 380 | 000813 | 天山纺织 | 58,300  | 655,875.00 | 0.11 |
| 381 | 000819 | 岳阳兴长 | 17,740  | 654,783.40 | 0.11 |
| 382 | 601009 | 南京银行 | 28,706  | 654,496.80 | 0.11 |
| 383 | 000728 | 国元证券 | 17,200  | 653,256.00 | 0.11 |
| 384 | 300384 | 三联虹普 | 6,620   | 648,693.80 | 0.11 |
| 385 | 300168 | 万达信息 | 13,200  | 648,384.00 | 0.11 |
| 386 | 300173 | 智慧松德 | 34,200  | 648,090.00 | 0.11 |
| 387 | 002564 | 天沃科技 | 51,500  | 638,600.00 | 0.11 |
| 388 | 300139 | 福星晓程 | 31,400  | 637,420.00 | 0.11 |
| 389 | 600129 | 太极集团 | 23,401  | 636,975.22 | 0.11 |
| 390 | 002007 | 华兰生物 | 14,300  | 633,347.00 | 0.11 |
| 391 | 600246 | 万通地产 | 118,860 | 632,335.20 | 0.11 |
| 392 | 600864 | 哈投股份 | 39,000  | 631,800.00 | 0.11 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 393 | 002663 | 普邦园林   | 64,294 | 623,651.80 | 0.11 |
| 394 | 300380 | 安硕信息   | 5,671  | 618,422.55 | 0.11 |
| 395 | 600703 | XD 三安光 | 19,752 | 618,237.60 | 0.11 |
| 396 | 002235 | 安妮股份   | 20,700 | 617,895.00 | 0.11 |
| 397 | 601028 | 玉龙股份   | 51,300 | 616,626.00 | 0.11 |
| 398 | 600100 | 同方股份   | 29,100 | 610,809.00 | 0.11 |
| 399 | 600584 | 长电科技   | 31,900 | 609,609.00 | 0.11 |
| 400 | 002707 | 众信旅游   | 6,400  | 603,136.00 | 0.10 |
| 401 | 000338 | 潍柴动力   | 19,000 | 601,540.00 | 0.10 |
| 402 | 002130 | 沃尔核材   | 30,100 | 601,398.00 | 0.10 |
| 403 | 300347 | 泰格医药   | 17,600 | 600,512.00 | 0.10 |
| 404 | 601700 | 风范股份   | 55,550 | 596,607.00 | 0.10 |
| 405 | 300398 | 飞凯材料   | 8,430  | 596,253.90 | 0.10 |
| 406 | 300172 | 中电环保   | 37,020 | 592,690.20 | 0.10 |
| 407 | 002681 | 奋达科技   | 21,480 | 589,840.80 | 0.10 |
| 408 | 300064 | 豫金刚石   | 45,200 | 587,600.00 | 0.10 |
| 409 | 300385 | 雪浪环境   | 9,300  | 586,830.00 | 0.10 |
| 410 | 300235 | 方直科技   | 18,500 | 585,895.00 | 0.10 |
| 411 | 000883 | 湖北能源   | 67,068 | 584,832.96 | 0.10 |
| 412 | 600229 | 青岛碱业   | 30,300 | 583,275.00 | 0.10 |
| 413 | 002610 | 爱康科技   | 41,800 | 581,020.00 | 0.10 |
| 414 | 002593 | 日上集团   | 24,000 | 578,880.00 | 0.10 |
| 415 | 300183 | 东软载波   | 20,300 | 578,550.00 | 0.10 |
| 416 | 300095 | 华伍股份   | 51,000 | 576,810.00 | 0.10 |
| 417 | 300400 | 劲拓股份   | 12,500 | 576,750.00 | 0.10 |
| 418 | 000811 | 烟台冰轮   | 37,000 | 572,760.00 | 0.10 |
| 419 | 300357 | 我武生物   | 13,100 | 567,623.00 | 0.10 |
| 420 | 002221 | 东华能源   | 19,000 | 566,770.00 | 0.10 |
| 421 | 300055 | 万邦达    | 23,400 | 566,046.00 | 0.10 |
| 422 | 600869 | 智慧能源   | 19,400 | 565,316.00 | 0.10 |
| 423 | 300028 | 金亚科技   | 20,800 | 561,600.00 | 0.10 |
| 424 | 300401 | 花园生物   | 24,900 | 557,262.00 | 0.10 |
| 425 | 600115 | 东方航空   | 43,600 | 537,152.00 | 0.09 |
| 426 | 600271 | 航天信息   | 8,300  | 537,093.00 | 0.09 |
| 427 | 300445 | 康斯特    | 5,199  | 536,328.84 | 0.09 |
| 428 | 300408 | 三环集团   | 15,300 | 533,358.00 | 0.09 |
| 429 | 300388 | 国祯环保   | 16,200 | 532,818.00 | 0.09 |
| 430 | 000402 | 金融街    | 37,500 | 529,875.00 | 0.09 |
| 431 | 603019 | 中科曙光   | 6,100  | 528,199.00 | 0.09 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 432 | 002407 | 多氟多  | 18,500 | 527,435.00 | 0.09 |
| 433 | 300412 | 迦南科技 | 13,900 | 526,393.00 | 0.09 |
| 434 | 600893 | 中航动力 | 9,900  | 526,185.00 | 0.09 |
| 435 | 300027 | 华谊兄弟 | 13,700 | 522,518.00 | 0.09 |
| 436 | 002152 | 广电运通 | 15,600 | 504,504.00 | 0.09 |
| 437 | 600009 | 上海机场 | 15,300 | 485,010.00 | 0.08 |
| 438 | 000416 | 民生控股 | 27,200 | 476,544.00 | 0.08 |
| 439 | 300203 | 聚光科技 | 11,400 | 469,566.00 | 0.08 |
| 440 | 002202 | 金风科技 | 24,100 | 469,227.00 | 0.08 |
| 441 | 002268 | 卫士通  | 5,500  | 440,770.00 | 0.08 |
| 442 | 600667 | 太极实业 | 75,800 | 439,640.00 | 0.08 |
| 443 | 601800 | 中国交建 | 25,000 | 439,000.00 | 0.08 |
| 444 | 002577 | 雷柏科技 | 5,310  | 427,986.00 | 0.07 |
| 445 | 002465 | 海格通信 | 13,200 | 424,908.00 | 0.07 |
| 446 | 601998 | 中信银行 | 54,400 | 419,424.00 | 0.07 |
| 447 | 000850 | 华茂股份 | 37,900 | 416,142.00 | 0.07 |
| 448 | 000686 | 东北证券 | 21,000 | 408,870.00 | 0.07 |
| 449 | 300287 | 飞利信  | 10,600 | 403,648.00 | 0.07 |
| 450 | 000748 | 长城信息 | 11,500 | 401,120.00 | 0.07 |
| 451 | 600645 | 中源协和 | 4,800  | 390,336.00 | 0.07 |
| 452 | 601179 | 中国西电 | 37,600 | 385,400.00 | 0.07 |
| 453 | 600741 | 华域汽车 | 17,995 | 384,193.25 | 0.07 |
| 454 | 600027 | 华电国际 | 33,800 | 375,856.00 | 0.07 |
| 455 | 000786 | 北新建材 | 19,400 | 371,122.00 | 0.06 |
| 456 | 600601 | 方正科技 | 40,100 | 364,910.00 | 0.06 |
| 457 | 000917 | 电广传媒 | 11,600 | 357,396.00 | 0.06 |
| 458 | 000826 | 桑德环境 | 9,100  | 353,899.00 | 0.06 |
| 459 | 002142 | 宁波银行 | 16,650 | 352,147.50 | 0.06 |
| 460 | 000981 | 银亿股份 | 13,436 | 341,274.40 | 0.06 |
| 461 | 000793 | 华闻传媒 | 19,500 | 329,355.00 | 0.06 |
| 462 | 601633 | 长城汽车 | 7,700  | 329,252.00 | 0.06 |
| 463 | 600143 | 金发科技 | 27,100 | 323,032.00 | 0.06 |
| 464 | 000792 | 盐湖股份 | 11,300 | 320,694.00 | 0.06 |
| 465 | 300297 | 蓝盾股份 | 9,900  | 316,701.00 | 0.05 |
| 466 | 300058 | 蓝色光标 | 19,684 | 311,204.04 | 0.05 |
| 467 | 000878 | 云南铜业 | 12,700 | 311,150.00 | 0.05 |
| 468 | 600879 | 航天电子 | 12,400 | 303,800.00 | 0.05 |
| 469 | 300291 | 华录百纳 | 7,958  | 300,494.08 | 0.05 |
| 470 | 000997 | 新大陆  | 11,100 | 295,260.00 | 0.05 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 471 | 300326 | 凯利泰  | 10,600 | 295,210.00 | 0.05 |
| 472 | 002400 | 省广股份 | 11,450 | 289,227.00 | 0.05 |
| 473 | 600079 | 人福医药 | 7,600  | 281,580.00 | 0.05 |
| 474 | 000089 | 深圳机场 | 24,800 | 279,744.00 | 0.05 |
| 475 | 600845 | 宝信软件 | 3,928  | 279,712.88 | 0.05 |
| 476 | 000750 | 国海证券 | 16,000 | 268,800.00 | 0.05 |
| 477 | 601098 | 中南传媒 | 11,700 | 268,047.00 | 0.05 |
| 478 | 000027 | 深圳能源 | 21,150 | 261,202.50 | 0.05 |
| 479 | 002020 | 京新药业 | 9,200  | 250,332.00 | 0.04 |
| 480 | 300020 | 银江股份 | 9,028  | 248,270.00 | 0.04 |
| 481 | 300251 | 光线传媒 | 9,770  | 243,273.00 | 0.04 |
| 482 | 600497 | 驰宏锌锗 | 16,600 | 242,194.00 | 0.04 |
| 483 | 300170 | 汉得信息 | 9,900  | 240,471.00 | 0.04 |
| 484 | 600012 | 皖通高速 | 18,000 | 233,640.00 | 0.04 |
| 485 | 601928 | 凤凰传媒 | 13,501 | 230,867.10 | 0.04 |
| 486 | 002470 | 金正大  | 10,600 | 230,126.00 | 0.04 |
| 487 | 600316 | 洪都航空 | 6,600  | 228,228.00 | 0.04 |
| 488 | 000977 | 浪潮信息 | 7,600  | 224,580.00 | 0.04 |
| 489 | 600548 | 深高速  | 25,000 | 213,750.00 | 0.04 |
| 490 | 002475 | 立讯精密 | 6,102  | 206,308.62 | 0.04 |
| 491 | 002292 | 奥飞动漫 | 5,334  | 201,891.90 | 0.04 |
| 492 | 002649 | 博彦科技 | 2,400  | 201,144.00 | 0.03 |
| 493 | 002063 | 远光软件 | 6,400  | 200,128.00 | 0.03 |
| 494 | 600990 | 四创电子 | 2,000  | 192,640.00 | 0.03 |
| 495 | 600578 | 京能电力 | 21,300 | 190,209.00 | 0.03 |
| 496 | 300010 | 立思辰  | 6,661  | 189,971.72 | 0.03 |
| 497 | 600098 | 广州发展 | 13,500 | 189,405.00 | 0.03 |
| 498 | 600270 | 外运发展 | 6,400  | 186,624.00 | 0.03 |
| 499 | 300229 | 拓尔思  | 7,100  | 183,890.00 | 0.03 |
| 500 | 000881 | 大连国际 | 13,600 | 178,840.00 | 0.03 |
| 501 | 002626 | 金达威  | 9,004  | 177,198.72 | 0.03 |
| 502 | 600038 | 中直股份 | 2,800  | 173,460.00 | 0.03 |
| 503 | 600190 | 锦州港  | 21,700 | 172,732.00 | 0.03 |
| 504 | 002416 | 爱施德  | 8,300  | 171,561.00 | 0.03 |
| 505 | 300252 | 金信诺  | 4,300  | 170,581.00 | 0.03 |
| 506 | 600687 | 刚泰控股 | 4,300  | 168,775.00 | 0.03 |
| 507 | 300133 | 华策影视 | 6,250  | 168,750.00 | 0.03 |
| 508 | 002179 | 中航光电 | 5,060  | 166,980.00 | 0.03 |
| 509 | 002308 | 威创股份 | 7,200  | 166,680.00 | 0.03 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 510 | 000415 | 渤海租赁 | 17,200 | 162,712.00 | 0.03 |
| 511 | 002587 | 奥拓电子 | 9,690  | 161,919.90 | 0.03 |
| 512 | 600523 | 贵航股份 | 5,200  | 160,316.00 | 0.03 |
| 513 | 300114 | 中航电测 | 3,620  | 159,243.80 | 0.03 |
| 514 | 601199 | 江南水务 | 4,500  | 158,670.00 | 0.03 |
| 515 | 000090 | 天健集团 | 6,500  | 157,625.00 | 0.03 |
| 516 | 000543 | 皖能电力 | 8,500  | 157,505.00 | 0.03 |
| 517 | 000685 | 中山公用 | 5,300  | 155,979.00 | 0.03 |
| 518 | 600486 | 扬农化工 | 4,200  | 151,116.00 | 0.03 |
| 519 | 600897 | 厦门空港 | 4,900  | 149,989.00 | 0.03 |
| 520 | 300128 | 锦富新材 | 6,600  | 149,160.00 | 0.03 |
| 521 | 600757 | 长江传媒 | 10,700 | 148,730.00 | 0.03 |
| 522 | 000910 | 大亚科技 | 8,700  | 148,074.00 | 0.03 |
| 523 | 002399 | 海普瑞  | 4,340  | 147,516.60 | 0.03 |
| 524 | 002111 | 威海广泰 | 4,500  | 145,530.00 | 0.03 |
| 525 | 601799 | 星宇股份 | 3,800  | 145,312.00 | 0.03 |
| 526 | 300075 | 数字政通 | 3,800  | 143,222.00 | 0.02 |
| 527 | 600590 | 泰豪科技 | 8,222  | 142,816.14 | 0.02 |
| 528 | 600023 | 浙能电力 | 14,100 | 139,872.00 | 0.02 |
| 529 | 000681 | 视觉中国 | 3,400  | 139,604.00 | 0.02 |
| 530 | 002518 | 科士达  | 4,460  | 138,527.60 | 0.02 |
| 531 | 002546 | 新联电子 | 4,100  | 135,956.00 | 0.02 |
| 532 | 000550 | 江铃汽车 | 3,608  | 132,413.60 | 0.02 |
| 533 | 000888 | 峨眉山A | 8,800  | 131,384.00 | 0.02 |
| 534 | 002214 | 大立科技 | 6,200  | 129,580.00 | 0.02 |
| 535 | 300333 | 兆日科技 | 1,201  | 129,467.80 | 0.02 |
| 536 | 000900 | 现代投资 | 12,600 | 129,276.00 | 0.02 |
| 537 | 000561 | 烽火电子 | 9,200  | 127,880.00 | 0.02 |
| 538 | 600888 | 新疆众和 | 10,400 | 125,320.00 | 0.02 |
| 539 | 600487 | 亨通光电 | 3,400  | 125,120.00 | 0.02 |
| 540 | 600004 | 白云机场 | 7,400  | 125,060.00 | 0.02 |
| 541 | 600290 | 华仪电气 | 9,299  | 124,978.56 | 0.02 |
| 542 | 600295 | 鄂尔多斯 | 10,300 | 123,600.00 | 0.02 |
| 543 | 002232 | 启明信息 | 6,300  | 119,070.00 | 0.02 |
| 544 | 002028 | 思源电气 | 6,400  | 117,760.00 | 0.02 |
| 545 | 300261 | 雅本化学 | 4,921  | 116,627.70 | 0.02 |
| 546 | 002427 | 尤夫股份 | 5,483  | 114,759.19 | 0.02 |
| 547 | 002177 | 御银股份 | 7,800  | 112,476.00 | 0.02 |
| 548 | 601677 | 明泰铝业 | 6,833  | 111,856.21 | 0.02 |

|     |        |        |       |            |      |
|-----|--------|--------|-------|------------|------|
| 549 | 002383 | 合众思壮   | 2,400 | 108,552.00 | 0.02 |
| 550 | 002533 | 金杯电工   | 8,100 | 105,219.00 | 0.02 |
| 551 | 600973 | 宝胜股份   | 6,900 | 105,087.00 | 0.02 |
| 552 | 002311 | 海大集团   | 7,420 | 102,321.80 | 0.02 |
| 553 | 002547 | 春兴精工   | 2,924 | 101,492.04 | 0.02 |
| 554 | 002039 | 黔源电力   | 4,900 | 101,332.00 | 0.02 |
| 555 | 002373 | 千方科技   | 2,300 | 99,567.00  | 0.02 |
| 556 | 600456 | 宝钛股份   | 3,800 | 99,066.00  | 0.02 |
| 557 | 600754 | 锦江股份   | 3,300 | 98,340.00  | 0.02 |
| 558 | 000045 | 深纺织 A  | 5,500 | 97,845.00  | 0.02 |
| 559 | 600459 | XD 贵研铂 | 4,200 | 97,818.00  | 0.02 |
| 560 | 002620 | 瑞和股份   | 1,664 | 97,327.36  | 0.02 |
| 561 | 300130 | 新国都    | 2,500 | 96,275.00  | 0.02 |
| 562 | 002609 | 捷顺科技   | 4,800 | 96,000.00  | 0.02 |
| 563 | 300158 | 振东制药   | 5,000 | 94,500.00  | 0.02 |
| 564 | 002289 | 宇顺电子   | 2,100 | 94,395.00  | 0.02 |
| 565 | 300056 | 三维丝    | 2,000 | 93,100.00  | 0.02 |
| 566 | 002199 | 东晶电子   | 6,200 | 92,504.00  | 0.02 |
| 567 | 300100 | 双林股份   | 4,815 | 91,629.45  | 0.02 |
| 568 | 300045 | 华力创通   | 4,900 | 90,062.00  | 0.02 |
| 569 | 002253 | 川大智胜   | 2,000 | 89,100.00  | 0.02 |
| 570 | 002539 | 新都化工   | 2,700 | 88,830.00  | 0.02 |
| 571 | 601126 | 四方股份   | 2,900 | 88,450.00  | 0.02 |
| 572 | 601801 | 皖新传媒   | 3,029 | 88,355.93  | 0.02 |
| 573 | 002320 | 海峡股份   | 3,200 | 87,776.00  | 0.02 |
| 574 | 300311 | 任子行    | 2,200 | 86,680.00  | 0.02 |
| 575 | 300036 | 超图软件   | 2,360 | 86,564.80  | 0.02 |
| 576 | 300013 | 新宁物流   | 3,300 | 85,503.00  | 0.01 |
| 577 | 300031 | 宝通带业   | 3,700 | 84,434.00  | 0.01 |
| 578 | 002090 | 金智科技   | 2,851 | 84,104.50  | 0.01 |
| 579 | 000426 | 兴业矿业   | 5,000 | 82,550.00  | 0.01 |
| 580 | 002025 | 航天电器   | 3,150 | 82,530.00  | 0.01 |
| 581 | 600097 | 开创国际   | 2,700 | 82,080.00  | 0.01 |
| 582 | 300369 | 绿盟科技   | 1,600 | 81,600.00  | 0.01 |
| 583 | 002206 | 海利得    | 4,800 | 80,832.00  | 0.01 |
| 584 | 600551 | 时代出版   | 3,700 | 80,327.00  | 0.01 |
| 585 | 600195 | 中牧股份   | 2,800 | 78,680.00  | 0.01 |
| 586 | 300177 | 中海达    | 4,000 | 78,360.00  | 0.01 |
| 587 | 000665 | 湖北广电   | 2,800 | 78,120.00  | 0.01 |

|     |        |        |       |           |      |
|-----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 588 | 002711 | 欧浦钢网   | 1,100 | 77,880.00 | 0.01 |
| 589 | 000980 | 金马股份   | 8,000 | 77,520.00 | 0.01 |
| 590 | 300150 | 世纪瑞尔   | 5,800 | 77,256.00 | 0.01 |
| 591 | 300160 | 秀强股份   | 3,300 | 75,570.00 | 0.01 |
| 592 | 300194 | 福安药业   | 2,700 | 71,415.00 | 0.01 |
| 593 | 300118 | 东方日升   | 5,800 | 69,774.00 | 0.01 |
| 594 | 300324 | 旋极信息   | 2,397 | 68,050.83 | 0.01 |
| 595 | 300245 | 天玑科技   | 2,800 | 67,788.00 | 0.01 |
| 596 | 000056 | 深国商    | 2,211 | 65,976.24 | 0.01 |
| 597 | 300180 | 华峰超纤   | 4,800 | 65,760.00 | 0.01 |
| 598 | 601231 | 环旭电子   | 3,800 | 64,638.00 | 0.01 |
| 599 | 002279 | 久其软件   | 1,200 | 64,200.00 | 0.01 |
| 600 | 300289 | 利德曼    | 1,200 | 62,400.00 | 0.01 |
| 601 | 300282 | 汇冠股份   | 1,155 | 62,150.55 | 0.01 |
| 602 | 002238 | 天威视讯   | 2,601 | 61,799.76 | 0.01 |
| 603 | 002635 | 安洁科技   | 2,500 | 60,875.00 | 0.01 |
| 604 | 300050 | 世纪鼎利   | 2,114 | 60,291.28 | 0.01 |
| 605 | 002557 | 洽洽食品   | 3,600 | 58,968.00 | 0.01 |
| 606 | 002295 | 精艺股份   | 2,900 | 58,551.00 | 0.01 |
| 607 | 002579 | 中京电子   | 3,700 | 58,460.00 | 0.01 |
| 608 | 002267 | 陕天然气   | 3,701 | 57,328.49 | 0.01 |
| 609 | 002395 | 双象股份   | 2,800 | 57,260.00 | 0.01 |
| 610 | 000156 | 华数传媒   | 1,600 | 57,248.00 | 0.01 |
| 611 | 300336 | 新文化    | 2,380 | 56,739.20 | 0.01 |
| 612 | 300209 | 天泽信息   | 2,376 | 55,954.80 | 0.01 |
| 613 | 600573 | XD 惠泉啤 | 3,900 | 53,703.00 | 0.01 |
| 614 | 002498 | 汉缆股份   | 2,600 | 53,482.00 | 0.01 |
| 615 | 300337 | 银邦股份   | 2,000 | 52,760.00 | 0.01 |
| 616 | 300325 | 德威新材   | 3,000 | 52,500.00 | 0.01 |
| 617 | 300290 | 荣科科技   | 1,300 | 51,974.00 | 0.01 |
| 618 | 002309 | 中利科技   | 1,500 | 50,085.00 | 0.01 |
| 619 | 002380 | 科远股份   | 838   | 49,173.84 | 0.01 |
| 620 | 300176 | 鸿特精密   | 1,840 | 48,373.60 | 0.01 |
| 621 | 002464 | 金利科技   | 2,900 | 46,806.00 | 0.01 |
| 622 | 002662 | 京威股份   | 2,600 | 46,384.00 | 0.01 |
| 623 | 002676 | 顺威股份   | 1,700 | 45,798.00 | 0.01 |
| 624 | 600985 | 雷鸣科化   | 2,020 | 44,904.60 | 0.01 |
| 625 | 002409 | 雅克科技   | 1,500 | 44,550.00 | 0.01 |
| 626 | 002580 | 圣阳股份   | 2,448 | 43,427.52 | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 627 | 300218 | 安利股份 | 2,600 | 40,326.00 | 0.01 |
| 628 | 300270 | 中威电子 | 2,180 | 39,806.80 | 0.01 |
| 629 | 002323 | 中联电气 | 1,230 | 39,581.40 | 0.01 |
| 630 | 300169 | 天晟新材 | 2,810 | 37,935.00 | 0.01 |
| 631 | 603399 | 新华龙  | 2,000 | 36,980.00 | 0.01 |
| 632 | 300330 | 华虹计通 | 1,800 | 36,036.00 | 0.01 |
| 633 | 002719 | 麦趣尔  | 500   | 35,005.00 | 0.01 |
| 634 | 300265 | 通光线缆 | 2,450 | 34,079.50 | 0.01 |
| 635 | 002560 | 通达股份 | 1,300 | 33,878.00 | 0.01 |
| 636 | 603333 | 明星电缆 | 3,200 | 30,880.00 | 0.01 |
| 637 | 000546 | 金圆股份 | 2,400 | 28,080.00 | 0.00 |
| 638 | 002696 | 百洋股份 | 1,200 | 26,004.00 | 0.00 |
| 639 | 002723 | 金莱特  | 1,000 | 18,810.00 | 0.00 |
| 640 | 002688 | 金河生物 | 500   | 14,850.00 | 0.00 |
| 641 | 000862 | 银星能源 | 1,100 | 12,991.00 | 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  | 601169 | 北京银行 | 19,001,586.04 | 2.77            |
| 2  | 600030 | 中信证券 | 14,123,113.70 | 2.06            |
| 3  | 601601 | 中国太保 | 11,974,205.67 | 1.75            |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 11,628,210.93 | 1.70            |
| 5  | 600837 | 海通证券 | 10,977,069.14 | 1.60            |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 8,712,955.18  | 1.27            |
| 7  | 600016 | 民生银行 | 8,682,163.12  | 1.27            |
| 8  | 601788 | 光大证券 | 7,184,781.00  | 1.05            |
| 9  | 000838 | 国兴地产 | 6,803,967.57  | 0.99            |
| 10 | 300043 | 互动娱乐 | 6,749,159.01  | 0.99            |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 6,705,359.00  | 0.98            |
| 12 | 000651 | 格力电器 | 6,540,461.99  | 0.96            |
| 13 | 601328 | 交通银行 | 6,348,936.00  | 0.93            |
| 14 | 000001 | 平安银行 | 6,269,756.04  | 0.92            |
| 15 | 002562 | 兄弟科技 | 5,991,859.48  | 0.87            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 16 | 000024 | 招商地产  | 5,892,111.05 | 0.86 |
| 17 | 600000 | 浦发银行  | 5,828,397.33 | 0.85 |
| 18 | 002075 | 沙钢股份  | 5,671,192.84 | 0.83 |
| 19 | 600383 | 金地集团  | 5,515,469.88 | 0.81 |
| 20 | 000069 | 华侨城 A | 5,383,950.44 | 0.79 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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  | 601318 | 中国平安 | 22,294,301.44 | 3.26            |
| 2  | 601169 | 北京银行 | 19,886,882.97 | 2.90            |
| 3  | 601166 | 兴业银行 | 19,201,241.25 | 2.80            |
| 4  | 601668 | 中国建筑 | 19,087,985.32 | 2.79            |
| 5  | 601390 | 中国中铁 | 18,837,422.90 | 2.75            |
| 6  | 600837 | 海通证券 | 18,778,362.55 | 2.74            |
| 7  | 600030 | 中信证券 | 17,247,110.02 | 2.52            |
| 8  | 600000 | 浦发银行 | 16,594,998.65 | 2.42            |
| 9  | 600016 | 民生银行 | 15,484,121.30 | 2.26            |
| 10 | 601818 | 光大银行 | 15,018,201.45 | 2.19            |
| 11 | 600015 | 华夏银行 | 14,895,394.76 | 2.18            |
| 12 | 601988 | 中国银行 | 14,715,858.47 | 2.15            |
| 13 | 600999 | 招商证券 | 14,561,696.32 | 2.13            |
| 14 | 000776 | 广发证券 | 14,088,444.18 | 2.06            |
| 15 | 000686 | 东北证券 | 13,676,175.12 | 2.00            |
| 16 | 601336 | 新华保险 | 12,601,969.54 | 1.84            |
| 17 | 601628 | 中国人寿 | 12,104,916.20 | 1.77            |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 11,899,475.02 | 1.74            |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 11,806,537.45 | 1.72            |
| 20 | 601800 | 中国交建 | 11,525,702.71 | 1.68            |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,626,323,020.41 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,003,419,783.97 |

注：买入股票成本、卖出股票成本均按照买卖成交金额（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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -         | -            |
| 2  | 央行票据      | -         | -            |
| 3  | 金融债券      | -         | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -         | -            |
| 4  | 企业债券      | -         | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -         | -            |
| 6  | 中期票据      | -         | -            |
| 7  | 可转债       | 34,874.40 | 0.01         |
| 8  | 其他        | -         | -            |
| 9  | 合计        | 34,874.40 | 0.01         |

**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**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 110031 | 航信转债 | 240   | 34,874.40 | 0.01         |

**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**

注：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**

注：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**

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 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

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体除步森股份（002569）外，本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。根据二〇一五年五月十四日浙江步森服饰股份有限公司（下称步森股份，股票代码：002569）《浙江步森服饰股份有限公司关于收到中国证监会调查通知书的公告》，步森股份于2015年5月12日接到中国证券监督管理委员会调查通知书（桂证调查通字2015017号），因涉嫌违反证券法律法规，中国证券监督管理委员会决定根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，对步森股份并购康华农业事项立案调查。截至本报告期末，步森股份尚未收到中国证监会就上述立案调查的结论性意见。基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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 | 376,360.90 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -             |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 12,954.11     |
| 5 | 应收申购款   | 10,797,686.31 |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 11,187,001.32 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 002624 | 完美环球 | 3,257,231.60   | 0.57         | 筹划重大事项   |
| 2  | 002264 | 新华都  | 3,195,992.88   | 0.55         | 筹划重大事项   |

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §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 |
| 16,422   | 23,276.98 | 21,607,599.70 | 5.65%  | 360,647,029.87 | 94.35% |

### 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 | 651,597.64 | 0.1705%  |

|       |  |  |
|-------|--|--|
| 持有本基金 |  |  |
|-------|--|--|

### 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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010年3月30日）基金份额总额 | 2,173,254,149.88 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 737,168,481.26   |
| 本报告期基金总申购份额               | 252,112,818.25   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 607,026,669.94   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）  | -                |
| 本报告期末基金份额总额               | 382,254,629.57   |

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于2015年5月29日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金投资策略未改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未更换会计师事务所。

**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，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 |    |
| 广发证券 | 1      | 1,684,182,360.15 | 46.40%       | 1,490,338.50 | 45.90%     | -  |
| 中投证券 | 1      | 759,323,805.37   | 20.92%       | 691,282.05   | 21.29%     | -  |
| 银河证券 | 1      | 611,022,140.55   | 16.83%       | 556,288.65   | 17.13%     | -  |
| 华泰证券 | 2      | 566,990,218.34   | 15.62%       | 501,737.29   | 15.45%     | -  |
| 华创证券 | 1      | 8,224,279.97     | 0.23%        | 7,487.40     | 0.23%      | -  |
| 国信证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

**A：选择标准**

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

**B：选择流程**

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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       |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 广发证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中投证券 | 910,945.50 | 100.00%      | 1,511,000,000.00 | 96.06%         | -    | -            |
| 银河证券 | -          | -            | 62,000,000.00    | 3.94%          | -    | -            |
| 华泰证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 华创证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -          | -            | -                | -              | -    | -            |

### 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  | 南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、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年6月30日 |
| 2  | 关于公司旗下基金调整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年6月30日 |
| 3  | 关于公司旗下基金调整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年6月27日 |
| 4  | 关于公司旗下基金调整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年6月26日 |

|    |  |                  |                 |
|----|--|------------------|-----------------|
| 5  | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 20 日 |
| 6  | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 19 日 |
| 7  | 关于南方策略优化股票型证券投资基金变更基金经理的公告               | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 17 日 |
| 8  | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 17 日 |
| 9  | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 13 日 |
| 10 | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 12 日 |
| 11 | 南方基金关于电子直销平台开通货币基金快速转购业务并实行 0 费率优惠的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 8 日  |
| 12 | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 6 日  |
| 13 | 关于公司旗下基金调整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 年 6 月 3 日  |
| 14 | 南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行、手机银行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 年 6 月 1 日  |
| 15 | 南方基金管理有限公司关于副总经理变更的公告                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 29 日 |
| 16 | 关于公司旗下基金调整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 年 5 月 27 日 |
| 17 | 关于公司旗下基金调整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 年 5 月 26 日 |
| 18 | 关于公司旗下基金调整停牌股票                           | 中国证券报、上海         | 2015 年 5 月 22 日 |

|    |  |                  |                 |
|----|--|------------------|-----------------|
|    | 估值方法的提示性公告                                     | 证券报、证券时报         |                 |
| 19 | 关于公司旗下基金调整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 年 5 月 20 日 |
| 20 | 南方基金关于旗下部分基金增加汇付金融为代销机构及开通定投和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 | 2015 年 5 月 18 日 |
| 21 | 南方基金关于旗下部分基金增加华融湘江银行为代销机构及开通定投和转换业务公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 15 日 |
| 22 | 关于公司旗下基金调整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 年 5 月 13 日 |
| 23 | 南方基金管理有限公司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 年 5 月 7 日  |
| 24 | 关于公司旗下基金调整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 年 4 月 28 日 |
| 25 | 南方基金管理有限公司深圳分公司负责人等信息变更的公告                     | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 28 日 |
| 26 | 南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员在子公司兼职情况变更的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 23 日 |
| 27 | 关于公司旗下基金调整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 年 4 月 23 日 |
| 28 | 南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 18 日 |
| 29 | 南方基金关于旗下部分基金增加晋商银行为代销机构及开通定投和转换业务公告            | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 15 日 |

|    |  |                  |                 |
|----|--|------------------|-----------------|
| 30 | 关于电子直销业务增加苏宁易购第三方支付业务的公告                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 15 日 |
| 31 | 关于公司旗下基金调整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 年 4 月 14 日 |
| 32 | 关于公司旗下基金调整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 年 4 月 10 日 |
| 33 | 南方基金关于淘宝直营店销售手续费费率优惠活动的公告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 10 日 |
| 34 | 南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构及开通定投和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 | 2015 年 4 月 8 日  |
| 35 | 关于公司旗下基金调整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 年 4 月 8 日  |
| 36 | 关于公司旗下基金调整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 年 4 月 7 日  |
| 37 | 南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告        | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 1 日  |
| 38 | 南方基金关于旗下部分基金增加增财基金为代销机构及开通定投和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 | 2015 年 3 月 31 日 |
| 39 | 南方基金关于旗下部分基金增加苏州银行为代销机构及开通定投和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 | 2015 年 3 月 27 日 |
| 40 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 26 日 |

|    |  |                  |                 |
|----|--|------------------|-----------------|
| 41 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 24 日 |
| 42 | 南方基金关于旗下部分基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和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 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 43 | 南方基金关于旗下部分基金增加西安银行为代销机构及开通定投和转换业务的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 44 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 17 日 |
| 45 | 南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 17 日 |
| 46 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 5 日  |
| 47 | 关于公司旗下基金调整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 年 2 月 28 日 |
| 48 | 南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 2 月 25 日 |
| 49 | 关于公司旗下基金调整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 年 2 月 12 日 |
| 50 | 南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 2 月 12 日 |
| 51 | 关于公司旗下基金调整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 年 2 月 3 日  |
| 52 | 南方基金关于旗下部分基金增加                                 | 中国证券报、上海         | 2015 年 3 月 27 日 |

|    |  |                  |                 |
|----|--|------------------|-----------------|
|    | 苏州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告               | 证券报、证券时报         |                 |
| 53 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 26 日 |
| 54 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 24 日 |
| 55 | 南方基金关于旗下部分基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和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 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 56 | 南方基金关于旗下部分基金增加西安银行为代销机构及开通定投和转换业务的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 23 日 |
| 57 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 17 日 |
| 58 | 南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 17 日 |
| 59 | 关于公司旗下基金调整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 年 3 月 5 日  |
| 60 | 关于公司旗下基金调整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 年 2 月 28 日 |
| 61 | 南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 2 月 25 日 |
| 62 | 关于公司旗下基金调整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 年 2 月 12 日 |
| 63 | 南方基金管理有限公司关于从业                                 | 中国证券报、上海         | 2015 年 2 月 12 日 |

|    |                          |                  |                 |
|----|--------------------------|------------------|-----------------|
|    | 人员在子公司兼任职务情况的公告          | 证券报、证券时报         |                 |
| 64 | 关于公司旗下基金调整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 年 2 月 3 日  |
| 65 | 关于公司旗下基金调整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 年 1 月 22 日 |
| 66 | 关于公司旗下基金调整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 年 1 月 17 日 |

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方策略优化股票型证券投资基金的文件。
- 2、《南方策略优化股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《南方策略优化股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《南方策略优化股票型证券投资基金 2015 年半年度报告》原文
- 5、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 11.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

### 11.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>