

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）
（原长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型）
2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期到期转型而成。长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金于 2012 年 5 月 22 日起进入三年分级运作期。在分级运作期内，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分为长盛同庆份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额三类风险收益特征不同的份额进行运作。上述分级运作期于 2015 年 5 月 21 日到期。根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的约定，在分级运作期到期后，同庆 800A 份额和同庆 800B 份额转换为长盛同庆 (LOF) 份额，长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金于 2015 年 5 月 22 日变更为非分级的指数型基金，基金名称相应变更为“长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)”。变更后，基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围不变。就前述基金变更事项，本基金管理人已按照相关法律法规及本基金基金合同约定履行相关备案手续。)

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 5 月 22 日 (基金合同生效日) 起至 06 月 30 日止。(注：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 5 月 21 日止)。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况 (转型后)	6
2.1 基金基本情况 (转型前)	6
2.2 基金产品说明 (转型后)	7
2.2 基金产品说明 (转型前)	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标 (转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标 (转型前)	9
3.2 基金净值表现 (转型后)	9
3.2 基金净值表现 (转型前)	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型前)	17
6.1 资产负债表 (转型前)	17
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型后)	39
6.1 资产负债表 (转型后)	39
6.2 利润表.....	40
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	41
6.4 报表附注.....	42
§ 7 投资组合报告 (转型前)	64
7.1 期末基金资产组合情况.....	64
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	65

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.....	66
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	85
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	86
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序号的前五名债券投资明细.....	86
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.....	86
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.....	86
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.....	86
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	86
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	87
7.12	投资组合报告附注.....	87
§ 7	投资组合报告 (转型后)	88
7.1	期末基金资产组合情况.....	88
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	89
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(转型后).....	90
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	111
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	112
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.....	113
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.....	113
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.....	113
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.....	113
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	113
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	113
7.12	投资组合报告附注.....	114
§ 8	基金份额持有人信息 (转型前)	115
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	115
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	116
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	116
8.4	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.....	116
§ 8	基金份额持有人信息 (转型后)	117
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	117
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	117
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	117
8.4	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.....	117
§ 9	开放式基金份额变动 (转型前)	117
§ 9	开放式基金份额变动 (转型后)	118
§ 10	重大事件揭示.....	118
10.1	基金份额持有人大会决议.....	118
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.....	118
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	118
10.4	基金投资策略的改变.....	119
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	119
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.....	119
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)	119
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)	121
10.8	其他重大事件 (转型前)	123

10.8 其他重大事件 (转型后)	125
§ 11 备查文件目录.....	126
11.1 备查文件目录.....	126
11.2 存放地点.....	126
11.3 查阅方式.....	126

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况 (转型后)

基金名称	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)
基金简称	长盛同庆中证 800 指数 (LOF)
场内简称	长盛同庆
基金主代码	160806
交易代码	160806
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 22 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	439,704,186.13 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015 年 8 月 6 日

2.1 基金基本情况 (转型前)

基金名称	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛同庆中证 800 分级		
场内简称	长盛同庆		
基金主代码	160806		
交易代码	160806		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2012 年 5 月 12 日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	542,268,490.78 份		
基金合同存续期	2012 年 5 月 22 日起进入三年分级运作期, 于 2015 年 5 月 21 日结束		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2012-05-31		
下属分级基金的基金简称	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
下属分级基金场内简称:	同庆 A	同庆 B	长盛同庆
下属分级基金的交易代码	150098	150099	160806
报告期末下属分级基金份额总额	0.00 份	0.00 份	542,268,490.78 份

注: 转型前报告期末指: 2015 年 5 月 21 日。

2.2 基金产品说明 (转型后)

投资目标	本基金运用指数化投资方式, 通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段, 力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内, 年跟踪误差控制在 4% 以内, 以实现中证 800 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略, 综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性, 通过抽样方式构建基金股票投资组合, 并优化确定投资组合中的个股权重, 以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%, 且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金, 具有高风险、高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.2 基金产品说明 (转型前)

投资目标	本基金运用指数化投资方式, 通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段, 力争将本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内, 年跟踪误差控制在 4% 以内, 以实现中证 800 指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金原则上采用抽样复制指数的投资策略, 综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性, 通过抽样方式构建基金股票投资组合, 并优化确定投资组合中的个股权重, 以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%, 且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。当预期成份股发生调整, 成份股发生配股、增发、分红等行为, 以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 800 指数的效果可能带来影响, 导致无法有效复制和跟踪标的指数时, 基金管理人可以根据市场情况, 采取合理措施, 在合理期限内进行适当的处理和调整, 以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。		
业绩比较基准	$95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$		
风险收益特征	本基金为抽样复制指数的股票型基金, 具有高风险、高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	长盛同庆 800A: 低风险、收益相对稳定。	长盛同庆 800B: 获取杠杆收益, 风险和预期收益均高于长盛同庆中证 800 分级份额。	长盛同庆中证 800 分级: 高风险、高预期收益。

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		长盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	田青
	联系电话	010-82019988	010-67595096
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	010-67595096
传真		010-82255988	010-66275853
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100088	100033
法定代表人		高新	王洪章

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	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标 (转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 5 月 22 日 - 2015 年 6 月 30 日)	
	转型后	
本期已实现收益	144,115,132.73	
本期利润	-52,695,271.81	
加权平均基金份额本期利润	-0.1111	
本期加权平均净值利润率	-5.90%	
本期基金份额净值增长率	-8.42%	
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	252,590,425.61	
期末可供分配基金份额利润	0.5745	
期末基金资产净值	722,215,236.05	
期末基金份额净值	1.643	
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	

基金份额累计净值增长率	-8.42%
-------------	--------

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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。

2、所列数据截止到 2015 年 6 月 30 日。

3、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。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

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5月21日)	
	转型前	
本期已实现收益	150,196,313.47	
本期利润	379,530,889.92	
加权平均基金份额本期利润	0.5409	
本期加权平均净值利润率	38.76%	
本期基金份额净值增长率	47.78%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年5月21日)	
期末可供分配利润	198,555,930.75	
期末可供分配基金份额利润	0.3662	
期末基金资产净值	972,864,247.08	
期末基金份额净值	1.794	
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年5月21日)	
基金份额累计净值增长率	92.59%	

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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。

2、所列数据截止到 2015 年 5 月 21 日。

3、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。

3.2 基金净值表现（转型后）

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	转型后					
	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	-9.48%	3.53%	-8.02%	3.34%	-1.46%	0.19%
自基金转型起至今	-8.42%	3.47%	-7.05%	3.28%	-1.37%	0.19%

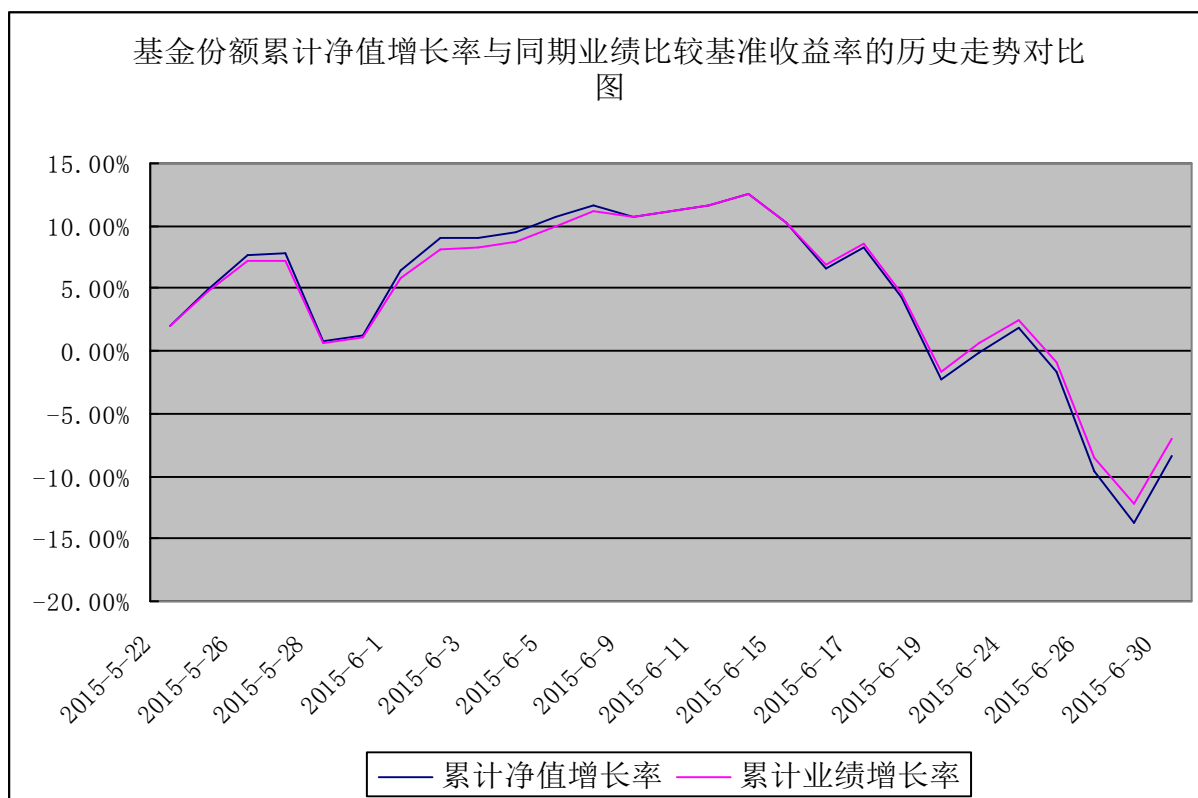
本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率 (税后)}$

本基金为指数型基金，股票资产跟踪的标的指数为中证 800 指数。中证 800 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数。其成份股由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金转型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



注：1、本基金由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金转型而来，基金转型日（即基金合同生效日）为 2015 年 5 月 22 日，截止本报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金将在基金合同生效 3 个月内使投资组合比例达到基金合同的相关规定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条（三）投资范围、（九）投资限制的有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%，现金或者到期日在

一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.2 基金净值表现 (转型前)

3.2.3 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

转型前						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.10%	2.05%	4.94%	1.98%	0.16%	0.07%
过去三个月	20.81%	1.71%	21.96%	1.65%	-1.15%	0.06%
过去六个月	47.78%	1.62%	45.11%	1.59%	2.67%	0.03%
过去一年	116.93%	1.38%	120.89%	1.35%	-3.96%	0.03%
过去三年	99.91%	1.27%	108.97%	1.26%	-9.06%	0.01%
自基金转型起至今	92.59%	1.25%	95.85%	1.25%	-3.26%	0.00%

本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

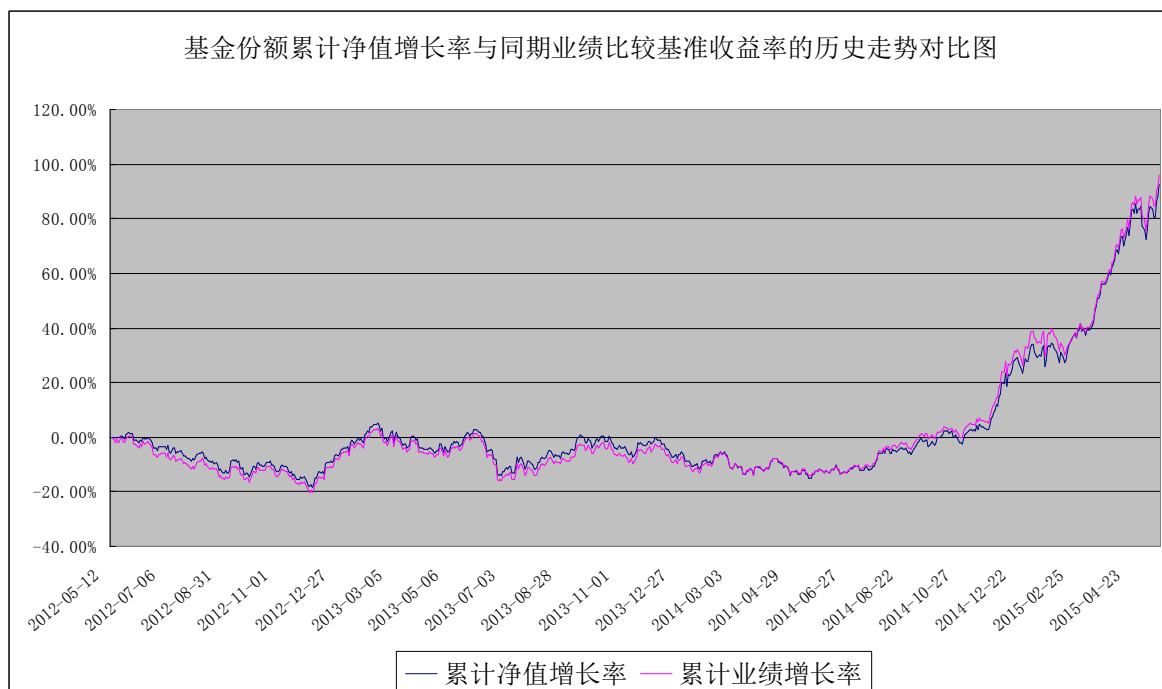
本基金业绩比较基准 = 95% × 中证 800 指数收益率 + 5% × 一年期银行定期存款利率 (税后)。

基准指数：中证 800 指数。

本基金的业绩比较基准中证 800 指数由中证指数有限公司构建和发布。具体的编制规则和再平衡过程请参见中证 800 指数指数编制细则。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中中证 800 指数、一年期银行定期存款每日按照 95%、5% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

3.2.4 自基金转型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



注：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金存续期为 2012 年 5 月 12 日至 2015 年 5 月 21 日。

§ 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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称“公司”），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2015 年 6 月 30 日，基金管理人共管理三十九只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理, 长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理, 长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。	2012 年 7 月 20 日	2015 年 5 月 21 日	8 年	男, 1981 年 9 月出生, 中国国籍。中央财经大学硕士, 金融风险管理师 (FRM)。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司, 曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员, 从事量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理, 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 (本基金) 基金经理, 长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。

注: 1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、“证券从业年限”中“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。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介 (转型后)

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	本基金基金经理, 长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理, 长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理, 长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 长盛	2015 年 5 月 22 日	-	8 年	男, 1981 年 9 月出生, 中国国籍。中央财经大学硕士, 金融风险管理师 (FRM)。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司, 曾任金融工程与量化投资部金融工程研究员, 从事量化投资策略研究和投资组合风险管理工作。现任长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理, 长盛同庆中证 800 指

	中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。			数型证券投资基金 (LOF, 本基金) 基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理，长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。
--	---	--	--	---

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“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，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估, 公司风险管理部、监察稽核部, 依照《公司公平交易细则》的规定, 持续、动态监督公司投资管理全过程, 并进行分析评估, 及时向公司管理层报告发现问题, 保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析, 计算溢价率、贡献率、占优比等指标, 使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验, 未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中, 未发生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。

本报告期内, 未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

在报告期内, 我们运用数量化投资手段精细化执行跟踪指数策略, 尽量降低申购赎回、个股配股、分红、增发等事件对基金组合产生的不利影响, 将本基金的跟踪误差和日均跟踪偏离度绝对值控制在合理水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日, 长盛同庆中证 800 指数 (LOF) 份额净值为 1.643 元, 本报告期 (2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日) 份额净值增长率为 -8.42%, 同期业绩比较基准增长率为 -7.05%。报告期内, 本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.19%, 控制在 0.35% 之内; 年化跟踪误差为 3.86%, 控制在 4% 之内。

截至 2015 年 5 月 21 日, 长盛同庆中证 800 指数分级份额净值为 1.794 元, 本报告期 (2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日) 份额净值增长率为 47.78%, 同期业绩比较基准增长率为 45.11%。报告期内, 本基金日均跟踪偏离度绝对值为 0.16%, 控制在 0.35% 之内; 年化跟踪误差为 3.60%, 控制在 4% 之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场在 2015 年上半年呈现了冲高之后大幅回落的特征。上证指数在 6 月 12 日创下本轮反弹新高 5178 之后, 便在清查场外配资等消息的影响下出现快速大幅下跌。前期出现大幅上涨的创业板和中小板成为主要下跌对象, 大盘蓝筹在下跌初期, 由于具有较好的流动性, 出现了恐慌性的抛售。针对杠杆平仓导致的本轮股市大幅下跌, 已经超出了市场正常价值回归的范围, 后面不

及时监管干预, 极有可能酿成系统性风险。对此监管机构也予以充分重视, 出台了密集的救市措施予以应对。二季度公布的宏观经济数据虽然还在探底, 但是已经出现了结构性回暖迹象, 相信在政府保增长政策密集出台的情况下, 宏观经济有望于三季度企稳。

展望2015年下半年的行情, 高估值类股票仍将处于估值回归的过程, 而估值具备明显优势的大盘蓝筹类股, 将受益于宏观经济触底反弹和国企改革等因素而预期出现上涨, 相对市场整体获得明显的超额收益。

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及本基金合同约定, 本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定, 对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序, 设立基金估值小组, 参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据, 确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组, 负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验, 具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论, 但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任, 当存有异议时, 托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释, 通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议, 由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

基金合同第十八条中对基金利润分配原则的约定, 本基金本报告期未实施利润分配。长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 截至 2015 年 6 月 30 日, 期末可供分配利润为 252, 590, 425. 61 元, 其中, 未分配利润已实现部分为 292, 245, 112. 29 元, 未分配利润未实现部分为-39, 654, 686. 68 元。

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同第二十一节中对基金利润分配原则的约定, 在本基金分级运作期内, 本基金 (包括长盛同庆 800A、长盛同庆 800B 和长盛同庆中证 800 分级基金份额) 不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 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

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内, 本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容, 保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型前)

6.1 资产负债表 (转型前)

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

报告截止日: 2015 年 5 月 21 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 5 月 21 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	38,034,965.95	60,365,980.34
结算备付金		-	694,771.26
存出保证金		229,267.93	1,213,680.45
交易性金融资产	6.4.7.2	905,725,908.69	969,984,095.68
其中: 股票投资		905,097,866.59	969,984,095.68
基金投资		-	-
债券投资		628,042.10	-
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	-	-
应收证券清算款		46,139,884.30	28,577,360.35
应收利息	6.4.7.5	80,780.10	18,930.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		990,210,806.97	1,060,854,818.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		15,274,647.79	22,556,787.67
应付管理人报酬		550,108.35	936,243.33
应付托管费		121,023.82	205,973.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	87,694.66	1,435,204.91
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	1,313,085.27	1,549,403.03
负债合计		17,346,559.89	26,683,612.46
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	579,170,644.88	909,795,613.87

未分配利润	6.4.7.10	393,693,602.20	124,375,591.88
所有者权益合计		972,864,247.08	1,034,171,205.75
负债和所有者权益总计		990,210,806.97	1,060,854,818.21

注：报告截止日 2015 年 5 月 21 日，基金份额净值 1.794 元，基金份额总额 542,268,490.78 份，其中长盛同庆 800A 基金份额为 0.00 份，长盛同庆 800B 基金份额为 0.00 份，长盛同庆中证 800 分级基金份额为 542,268,490.78 份。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		385,227,836.10	-74,432,668.97
1. 利息收入		198,146.76	534,694.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	197,987.74	513,960.42
债券利息收入		159.02	20,734.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		155,109,715.73	-36,595,058.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	153,674,444.19	-57,599,070.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	42,817.11	31,199.06
资产支持证券投资收益		-	-
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	1,392,454.43	20,972,812.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	229,334,576.45	-39,028,098.30
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	585,397.16	655,792.68
减：二、费用		5,696,946.18	15,479,686.94
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,778,505.91	9,002,864.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	831,271.26	1,980,630.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	904,156.09	4,207,707.43
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, 012. 92	288, 484. 62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		379, 530, 889. 92	-89, 912, 355. 91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		379, 530, 889. 92	-89, 912, 355. 91

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 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）	909, 795, 613. 87	124, 375, 591. 88	1, 034, 171, 205. 75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	379, 530, 889. 92	379, 530, 889. 92
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）	-330, 624, 968. 99	-110, 212, 879. 60	-440, 837, 848. 59
其中：1. 基金申购款	89, 137, 038. 94	15, 149, 616. 07	104, 286, 655. 01
2. 基金赎回款	-419, 762, 007. 93	-125, 362, 495. 67	-545, 124, 503. 60
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）	579, 170, 644. 88	393, 693, 602. 20	972, 864, 247. 08
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2, 202, 863, 302. 40	-369, 610, 081. 97	1, 833, 253, 220. 43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-89, 912, 355. 91	-89, 912, 355. 91
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	1, 177, 195, 141. 04	-303, 997, 900. 69	873, 197, 240. 35

其中：1. 基金申购款	1,857,055,812.46	-448,396,586.89	1,408,659,225.57
2. 基金赎回款	-679,860,671.42	144,398,686.20	-535,461,985.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,380,058,443.44	-763,520,338.57	2,616,538,104.87

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：

<u>周兵</u>	<u>杨思乐</u>	<u>龚珉</u>
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 基金基本情况

长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金是根据长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金（以下简称“长盛同庆封闭基金”）基金份额持有人大会 2012 年 4 月 10 日决议通过的《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可字[2012]549 号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，由原基金长盛同庆封闭基金转型而来。原基金长盛同庆封闭基金为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限至 2012 年 5 月 11 日止。根据深交所《终止上市通知书》（深证上[2012]116 号）的同意，自 2012 年 5 月 14 日起，原基金长盛同庆封闭基金终止上市，并更名为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原长盛同庆封闭基金于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 12,925,228,407.02 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。此外，根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》、《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期同庆 A、同庆 B 停止转托管业务并进行基金份额转换的公告》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金封闭期到期基金份额转换结果的公告》的规定，本基金的基金管理人于 2012 年 5 月 14 日对原长盛同庆封闭之同庆 A 和同庆 B 份额进行了基金份额转换，将原长盛同庆封闭基金之同庆 A 和同庆 B 份额折算为长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之基础份额（以下简称“长盛同庆中证 800 分级份额”），并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金进入分级运作期份额折算及分拆的公告》的规定, 本基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期, 为期三年; 分级运作期到期后, 本基金将转换为上市开放式基金(LOF)。在分级运作期起始日, 即 2012 年 5 月 22 日, 本基金的基金管理人对长盛同庆中证 800 分级份额进行了份额折算, 折算后长盛同庆中证 800 分级份额的份额净值为人民币 1.000 元。

根据基金合同的有关规定, 本基金在分级运作期内的基金份额包括长盛同庆中证 800 分级份额、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(以下简称“同庆 800A 份额”)以及长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“同庆 800B 份额”)。本基金在分级运作期起始日, 场内长盛同庆中证 800 分级份额按 4:6 的比例分离成同庆 800A 份额和同庆 800B 份额, 各类基金份额的基金资产合并运作。

长盛同庆中证 800 分级份额只接受场外与场内申购和赎回, 同庆 800A 份额和同庆 800B 份额可单独在上市交易但不接受申购和赎回。经深交所深证上[2012]137 号文审核同意, 同庆 800A 份额和同庆 800B 份额于 2012 年 5 月 31 日在深交所挂牌交易。截至 2012 年 5 月 30 日, 长盛同庆基金份额净值为 1.013 元, 同庆 800A 基金份额参考净值为 1.002 元, 同庆 800B 基金份额参考净值为 1.020 元。未上市交易的长盛同庆中证 800 分级份额托管在场外, 基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可按照 4:6 的比例与同庆 800A 份额和同庆 800B 份额进行配对转换。

在分级运作期内, 在自分级运作期起始日后满一年和满两年的对应日(若该对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日), 本基金的基金管理人将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行份额折算; 此外, 若同庆 800B 份额的参考净值跌至 0.250 元以下, 本基金的基金管理人还将根据基金合同的规定对长盛同庆中证 800 分级份额、同庆 800A 份额和同庆 800B 份额的基金份额进行不定期份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定, 本基金的投资范围为本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%, 其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%; 其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种, 其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期}$

银行定期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 5 月 21 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 5 月 21 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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),本基金自 2015 年 3 月 24 日起按照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》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

除上述会计估值变更事项外,本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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,本基金自 2015 年 3 月 24 日起采用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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,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。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2015年5月21日
活期存款	38,034,965.95
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计:	38,034,965.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2015年5月21日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	520,196,195.54	905,097,866.59	384,901,671.05

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	287,000.00	628,042.10
	银行间市场	-	-
	合计	287,000.00	628,042.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	520,483,195.54	905,725,908.69	385,242,713.15

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年5月21日
应收活期存款利息	77,662.07
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	0.28
应收债券利息	137.13
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,999.98
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	980.64
合计	80,780.10

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年5月21日
交易所市场应付交易费用	87,694.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	87,694.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 5 月 21 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	37,007.67
其他	609,966.91
预提费用	166,110.69
合计	1,313,085.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	851,840,430.56	909,795,613.87
本期申购	83,429,559.28	89,137,038.94
本期赎回 (以“-”号填列)	-393,001,498.06	-419,762,007.93
2015 年 5 月 21 日基金拆分/份额折算前	542,268,491.78	579,170,644.88
基金拆分/份额折算变动份额	-1.00	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	542,268,490.78	579,170,644.88

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。2、根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，同庆 800A 份额、同庆 800B 份额于 2015 年 5 月 21 日终止上市。本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终，将同庆 800A 份额、同庆 800B 份额以各自的基金份额净值为基准转换为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	110,534,905.74	13,840,686.14	124,375,591.88
本期利润	150,196,313.47	229,334,576.45	379,530,889.92
本期基金份额交易产生的变动数	-62,175,288.46	-48,037,591.14	-110,212,879.60
其中：基金申购款	11,113,834.02	4,035,782.05	15,149,616.07
基金赎回款	-73,289,122.48	-52,073,373.19	-125,362,495.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	198,555,930.75	195,137,671.45	393,693,602.20

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
活期存款利息收入	186,037.57
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	5,481.02
其他	6,469.15
合计	197,987.74

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
卖出股票成交总额	455,745,796.14
减：卖出股票成本总额	302,071,351.95
买卖股票差价收入	153,674,444.19

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付） 差价收入	42,817.11
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	42,817.11

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	95,839.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	53,000.00
减：应收利息总额	21.89
买卖债券差价收入	42,817.11

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
股票投资产生的股利收益	1,392,454.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,392,454.43

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
1. 交易性金融资产	229,334,576.45
——股票投资	228,993,534.35
——债券投资	341,042.10
——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	229,334,576.45

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
基金赎回费收入	585,397.16
合计	585,397.16

注：1、本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率固定为 0.50%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	904,156.09
银行间市场交易费用	-
合计	904,156.09

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日
审计费用	38,629.77
信息披露费	104,303.34
深交所上市年费	23,177.58
银行划款费用	7,542.23
其他费用	360.00
帐户维护费	9,000.00
合计	183,012.92

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日 至 2015 年 5 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日 至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,778,505.91	9,002,864.64
其中：支付销售机构的客户维护费 ¹	122,656.54	186,730.54

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	831,271.26	1,980,630.25

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度末未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 5 月 21 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	38,034,965.95	186,037.57	181,492,286.97	466,829.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2015 年 5 月 21 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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	复牌日期	复牌	数量（股）	期末	期末	备注
				估值单价		开盘		成本总额	估值总额	
601766	中国中车	20150507	重大事项	33.77	20150608	32.4	361,882	6,241,858.66	12,220,755.14	-
601899	紫金矿业	20150422	重大事项	5.36	20150527	5.76	547,006	1,378,947.64	2,931,952.16	-
600584	长电科技	20150407	重大事项	23.54	20150521	19.68	123,300	1,353,367.44	2,902,482.00	-
000024	招商地产	20150403	重大事项	38.27	-	-	71,507	1,726,893.33	2,736,572.89	-
601888	中国国旅	20150316	重大事项	82.59	20150604	56.5	27,039	1,121,742.05	2,233,151.01	-
300017	网宿科技	20150513	重大事项	59.46	20150615	60.07	29,843	653,265.97	1,774,464.78	-
002081	金螳螂	20150512	重大事项	32.53	20150617	35.67	54,195	890,472.79	1,762,963.35	-
600597	光明乳业	20150309	重大事项	29.08	20150609	21.52	44,702	776,381.48	1,299,934.16	-
000630	铜陵	20150501	重大	22.98	-	-	56,107	856,838.61	1,289,338.86	-

	有色	309	事项							
600645	中源 协和	20150 427	重大 事项	99.26	-	-	12,448	504,909.62	1,235,588.48	-
600516	方大 炭素	20150 331	重大 事项	15.90	2015 0603	14.34	71,403	758,621.95	1,135,307.70	-
600522	中天 科技	20150 309	重大 事项	30.37	2015 0525	20.01	29,792	432,315.37	904,783.04	-
600872	中炬 高新	20150 504	重大 事项	23.99	-	-	37,456	387,505.61	898,569.44	-
002292	奥飞 动漫	20150 518	重大 事项	75.78	-	-	11,589	343,024.55	878,214.42	-
600879	航天 电子	20150 515	重大 事项	24.50	-	-	34,524	542,050.03	845,838.00	-
600797	浙大 网新	20150 211	重大 事项	18.75	2015 0601	10.01	43,372	318,845.39	813,225.00	-
600765	中航 重机	20150 505	重大 事项	37.74	2015 0609	33.84	20,499	415,348.64	773,632.26	-
002701	奥瑞 金	20150 514	重大 事项	31.08	2015 0624	31.88	24,460	322,006.86	760,216.80	-
600967	北方 创业	20150 413	重大 事项	24.39	-	-	30,568	420,278.32	745,553.52	-
002001	新和 成	20150 521	重大 事项	20.07	2015 0522	21.98	33,753	514,365.77	677,422.71	-
002221	东华 能源	20150 424	重大 事项	48.48	2015 0525	46.04	12,910	213,444.27	625,876.80	-
600151	航天 机电	20150 508	重大 事项	19.96	2015 0612	16.91	31,281	299,266.63	624,368.76	-
002368	太极 股份	20150 514	重大 事项	107.93	-	-	5,772	247,926.86	622,971.96	-
600572	康恩 贝	20150 427	重大 事项	32.16	2015 0608	30.57	17,893	307,303.91	575,438.88	-
000786	北新 建材	20150 410	重大 事项	43.19	-	-	13,162	226,259.49	568,466.78	-
000690	宝新 能源	20150 513	重大 事项	11.02	2015 0603	12.12	50,656	315,080.32	558,229.12	-
002429	兆驰 股份	20150 519	重大 事项	14.15	2015 0619	15.53	39,329	303,203.78	556,505.35	-
600376	首开 股份	20150 513	重大 事项	13.76	2015 0603	15.14	37,609	187,356.27	517,499.84	-
002106	莱宝 高科	20150 407	重大 事项	21.64	-	-	23,046	295,290.54	498,715.44	-
600747	大连 控股	20150 204	重大 事项	9.21	2015 0623	6.8	54,104	361,462.61	498,297.84	-
600086	东方	20150	重大	46.90	2015	36.3	9,900	251,378.68	464,310.00	-

	金钰	319	事项		0615					
000536	华映科技	20150 521	重大事项	23.58	2015 0603	25.94	19,240	287,354.35	453,679.20	-
600289	亿阳信通	20150 513	重大事项	23.96	2015 0527	26.36	18,786	189,198.38	450,112.56	-
000959	首钢股份	20150 423	重大事项	6.03	-	-	74,405	297,548.46	448,662.15	-
600970	中材国际	20150 504	重大事项	21.39	2015 0601	19.50	20,962	281,205.23	448,377.18	-
300088	长信科技	20150 518	重大事项	32.00	2015 0610	31.9	13,455	204,794.81	430,560.00	-
000062	深圳华强	20150 313	重大事项	44.87	2015 0521	30.04	9,483	151,086.50	425,502.21	-
002093	国脉科技	20150 415	重大事项	20.68	2015 0520	16.67	19,194	117,217.30	396,931.92	-
000697	炼石有色	20150 518	重大事项	33.85	-	-	11,698	237,245.03	395,977.30	-
600259	广晟有色	20150 504	重大事项	65.01	2015 0601	72.81	6,064	357,887.78	394,220.64	-
002414	高德红外	20150 513	重大事项	39.38	-	-	9,921	228,099.08	390,688.98	-
600614	鼎立股份	20150 330	重大事项	32.13	2015 0623	26.06	11,726	162,792.89	376,756.38	-
000021	深科技	20150 519	重大事项	15.00	2015 0603	16.5	24,421	187,417.30	366,315.00	-
600628	新世界	20150 408	重大事项	17.75	2015 0617	15.7	20,055	202,904.93	355,976.25	-
000510	*ST 金路	20150 119	重大事项	10.00	2015 0624	6.09	34,906	190,743.20	349,060.00	-
002727	一心堂	20150 413	重大事项	95.05	2015 0817	70.42	3,645	149,496.51	346,457.25	-
000669	金鸿能源	20150 504	重大事项	39.01	2015 0723	33.95	8,846	255,472.48	345,082.46	-
002249	大洋电机	20150 320	重大事项	14.30	2015 0616	10.54	23,600	139,894.90	337,480.00	-
000850	华茂股份	20150 507	重大事项	13.84	-	-	23,333	179,504.71	322,928.72	-
002416	爱施德	20150 505	重大事项	24.18	2015 0729	18.6	12,922	139,865.62	312,453.96	-
600869	智慧能源	20150 511	重大事项	35.22	2015 0731	26.23	8,267	73,080.99	291,163.74	-
002203	海亮股份	20150 427	重大事项	13.23	-	-	21,942	134,524.12	290,292.66	-
603555	贵人	20150	重大	53.89	2015	59.28	5,183	89,770.98	279,311.87	-

	鸟	519	事项		0522					
002216	三全食品	20150 519	重大 事项	20.50	2015 0529	22.54	13,608	136,284.12	278,964.00	-
600657	信达地产	20150 521	重大 事项	10.07	2015 0604	11.08	25,567	189,265.71	257,459.69	-
601777	力帆股份	20150 427	重大 事项	15.72	2015 0526	16.12	13,455	121,498.65	211,512.60	-
002662	京威股份	20150 515	重大 事项	18.14	2015 0813	16.06	6,389	66,952.13	115,896.46	-

注：1、本基金截至 2015 年 5 月 21 日持有的长电科技、深圳华强、国脉科技已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。2、本基金截至 2015 年 5 月 21 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。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，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、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控制管理委员会，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与风险管理部负责，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。

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,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,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中国建设银行,因而与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,且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 5 月 21 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 0.06%(2014 年 12 月 31 日:本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券,因此不存在重大信用风险(2014 年 12 月 31 日:同))。

6.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均可以合理的价格适时变现。

于 2015 年 5 月 21 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位:人民币元

本期末 2015 年 5 月 21 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	38,034,965.95	-	-	-	38,034,965.95
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	229,267.93	-	-	-	229,267.93
交易性金融资产	-	-	628,042.10	905,097,866.59	905,725,908.69
应收证券清算款	-	-	-	46,139,884.30	46,139,884.30
应收利息	-	-	-	80,780.10	80,780.10

资产总计	38,264,233.88	-	628,042.10	951,318,530.99	990,210,806.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	15,274,647.79	15,274,647.79
应付管理人报酬	-	-	-	550,108.35	550,108.35
应付托管费	-	-	-	121,023.82	121,023.82
应付交易费用	-	-	-	87,694.66	87,694.66
其他负债	-	-	-	1,313,085.27	1,313,085.27
负债总计	-	-	-	17,346,559.89	17,346,559.89
利率敏感度缺口	38,264,233.88	-	628,042.10	933,971,971.10	972,864,247.08
上年度末					
2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	60,365,980.34	-	-	-	60,365,980.34
结算备付金	694,771.26	-	-	-	694,771.26
存出保证金	1,213,680.45	-	-	-	1,213,680.45
交易性金融资产	-	-	-	969,984,095.68	969,984,095.68
应收证券清算款	-	-	-	28,577,360.35	28,577,360.35
应收利息	-	-	-	18,930.13	18,930.13
资产总计	62,274,432.05	-	-	998,580,386.16	1,060,854,818.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,556,787.67	22,556,787.67
应付管理人报酬	-	-	-	936,243.33	936,243.33
应付托管费	-	-	-	205,973.52	205,973.52
应付交易费用	-	-	-	1,435,204.91	1,435,204.91
其他负债	-	-	-	1,549,403.03	1,549,403.03
负债总计	-	-	-	26,683,612.46	26,683,612.46
利率敏感度缺口	62,274,432.05	-	-	971,896,773.70	1,034,171,205.75

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2015 年 5 月 21 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 0.06% (2014 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资，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))。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 5 月 21 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	905,097,866.59	93.03	969,984,095.68	93.79
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	905,097,866.59	93.03	969,984,095.68	93.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 5 月 21 日)	上年度末 (2014 年 12 月 31 日)

	业绩比较基准上升 5%	51,561,805.10	51,919,762.62
	业绩比较基准下降 5%	-51,561,805.10	-51,919,762.62

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 5 月 21 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 851,723,439.02 元，属于第二层次的余额为 54,002,469.67 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 919,972,205.79 元，第二层次 50,011,889.89 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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)，本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用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(附注 6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计) (转型后)

6.1 资产负债表 (转型后)

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产:		
银行存款	6.4.7.1	53,171,532.33
结算备付金		-
存出保证金		220,137.48
交易性金融资产	6.4.7.2	674,656,487.78
其中: 股票投资		674,564,942.48
基金投资		-
债券投资		91,545.30
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	11,107.95
应收股利		-
应收申购款		50,198.23
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		728,109,463.77
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		3,215,716.43
应付管理人报酬		705,013.08
应付托管费		155,102.87
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	508,709.10
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	1,309,686.24
负债合计		5,894,227.72
所有者权益:		

实收基金	6.4.7.9	469,624,810.44
未分配利润	6.4.7.10	252,590,425.61
所有者权益合计		722,215,236.05
负债和所有者权益总计		728,109,463.77

注：1、报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.643 元，基金份额总额 439,704,186.13 份。2、本基金合同于 2015 年 5 月 22 日生效，本财务报表的实际编制期间为 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-50,670,755.14
1. 利息收入		45,860.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	45,824.90
债券利息收入		35.97
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		145,856,478.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	142,308,690.73
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	433,283.05
资产支持证券投资收益		-
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	3,114,505.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-196,810,404.54
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	237,309.62
减：二、费用		2,024,516.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	969,766.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	213,348.73
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	791,445.55
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	49,955.43

三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-52,695,271.81
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-52,695,271.81

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 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)	579,170,644.88	393,693,602.20	972,864,247.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-52,695,271.81	-52,695,271.81
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)	-109,545,834.44	-88,407,904.78	-197,953,739.22
其中: 1. 基金申购款	623,266.14	495,610.40	1,118,876.54
2. 基金赎回款	-110,169,100.58	-88,903,515.18	-199,072,615.76
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)	469,624,810.44	252,590,425.61	722,215,236.05

注: 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:

周兵

杨思乐

龚珉

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 基金基本情况

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 由长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金 (以下简称“长盛同庆 800 分级基金”) 分级运作期到期转型而成; 长盛同庆 800 分级基金是由长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金 (以下简称“长盛同庆封闭基金”) 转型而成。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金(以下简称“长盛同庆封闭基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 209 号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案,《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 5 月 12 日正式生效。

长盛同庆 800 分级基金是根据长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金(以下简称“长盛同庆封闭基金”)基金份额持有人大会 2012 年 4 月 10 日决议通过的《关于长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金转型有关事项的议案》,经中国证监会证监许可字[2012]549 号《关于核准长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》,由原长盛同庆封闭基金转型而来。长盛同庆封闭基金为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至 2012 年 5 月 11 日止。根据深交所《终止上市通知书》(深证上[2012]116 号)的同意,自 2012 年 5 月 14 日起,原长盛同庆封闭基金终止上市,并转型为长盛同庆 800 分级基金,《长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金合同》失效的同时《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》生效。

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的规定,本基金的基金管理人于长盛同庆 800 分级基金分级运作期起始日,即 2012 年 5 月 22 日对长盛同庆中证 800 分级份额进行了份额折算,折算后长盛同庆中证 800 分级份额的份额净值为人民币 1.000 元;长盛同庆 800 分级基金自 2012 年 5 月 22 日起进入分级运作期,为期三年;分级运作期到期后,长盛同庆 800 分级基金将转换为上市开放式基金(LOF)。根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果的公告》,本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终,对原长盛同庆 800 分级基金 A 类份额和 B 类份额以各自的基金份额净值为基准转换为本基金的基金份额。自 2015 年 5 月 22 日起,《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金基金合同》生效,本基金名称相应变更为“长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)。”

经深圳证券交易所深证上[2015]378 号审核同意,本基金 292,227,017.00 份基金份额于 2015 年 8 月 6 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定,本基金的投资范围为本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法

规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0—3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 5\% \times \text{一年期银行定期存款利率(税后)}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会及中国证券投资基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 5 月 22 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 5 月 22 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和各类其他应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类其他应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最

近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允

价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%；

(4) 场外申购的，登记在注册登记系统的基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，但场外基金份额持有人可以事先选择将所获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；若基金份额持有人事先未做出选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(5) 场内申购和上市交易的，登记在证券登记结算系统的基金份额的分红方式只能为现金分红，基金份额持有人不能选择其他的分红方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所和中国证券登记结算有限公司的相关规定；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(7) 基金收益分配后每一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；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部

分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财政部、国家税务总局、中国证监会于2012年11月16日联合发布财税[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。

4、自 2013 年 1 月 1 日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。

5、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	53,171,532.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	53,171,532.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	486,161,179.17	674,564,942.48	188,403,763.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	91,545.30	28,545.30
	银行间市场	-	-
	合计	91,545.30	28,545.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	486,224,179.17	674,656,487.78	188,432,308.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	9,013.49
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	0.04
应收债券利息	5.25
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,999.98
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	89.19
合计	11,107.95

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	508,709.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	508,709.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	9,000.82
其他	612,451.13
预提费用	188,234.29
合计	1,309,686.24

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	542,268,490.78	579,170,644.88
本期申购	583,555.65	623,266.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-103,147,860.30	-110,169,100.58
本期末	439,704,186.13	469,624,810.44

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	198,555,930.75	195,137,671.45	393,693,602.20
本期利润	144,115,132.73	-196,810,404.54	-52,695,271.81
本期基金份额交易产生的变动数	-50,425,951.19	-37,981,953.59	-88,407,904.78
其中：基金申购款	324,653.09	170,957.31	495,610.40
基金赎回款	-50,750,604.28	-38,152,910.90	-88,903,515.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	292,245,112.29	-39,654,686.68	252,590,425.61

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期
	2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	45,422.86
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	0.95
其他	401.09
合计	45,824.90

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	319,422,171.61
减：卖出股票成本总额	177,113,480.88
买卖股票差价收入	142,308,690.73

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	433,283.05
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	433,283.05

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月22日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	720,450.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	287,000.00
减：应收利息总额	167.85
买卖债券差价收入	433,283.05

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年5月22日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,114,505.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,114,505.13

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年5月22日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	-196,810,404.54
——股票投资	-196,497,907.74
——债券投资	-312,496.80
——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	-196,810,404.54
----	-----------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	237,309.62
合计	237,309.62

注：本基金的场外赎回费率按持有期间递减，场内赎回费率固定为 0.50%，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	791,445.55
银行间市场交易费用	-
合计	791,445.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	10,958.80
信息披露费	29,589.60
深交所上市年费	6,575.20
银行划款费用	2,831.83
合计	49,955.43

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，未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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司 (“长盛基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期未通过关联方交易单元发生交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	969,766.96
其中：支付销售机构的客户维护费	27,972.18

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 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：日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	213,348.73

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：基金管理人本期未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方本期未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2015 年 5 月 22 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	53,171,532.33	45,422.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本期无利润分配事项。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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	复牌期	复牌	数量 (股)	期末	期末	备注
				估值价		开盘 单价		成本总额	估值总额	
600900	长江电力	20150615	重大事项	12.37	-	-	216,220	2,205,802.63	2,674,641.40	-
000024	招商地产	20150403	重大事项	36.50	-	-	71,507	1,726,893.33	2,610,005.50	-
600886	国投	20150624	重大	14.87	-	-	145,878	965,095.36	2,169,205.86	-

	电力		事项							
002183	怡亚通	20150601	重大事项	65.78	-	-	23,358	340,422.62	1,536,489.24	-
000917	电广传媒	20150528	重大事项	30.82	-	-	41,338	697,549.73	1,274,037.16	-
000709	河北钢铁	20150630	重大事项	7.00	20150824	6.30	181,098	368,783.44	1,267,686.00	-
600153	建发股份	20150629	重大事项	17.51	-	-	72,264	721,291.46	1,265,342.64	-
000793	华闻传媒	20150526	重大事项	16.89	-	-	69,395	788,511.73	1,172,081.55	-
000630	铜陵有色	20150309	重大事项	10.32	-	-	112,214	856,838.61	1,158,048.48	-
601111	中国国航	20150630	重大事项	15.36	20150729	13.78	72,124	559,405.25	1,107,824.64	-
002354	天神娱乐	20150528	重大事项	69.62	20150723	87.27	15,786	766,281.61	1,099,021.32	
600645	中源协和	20150427	重大事项	81.32	-	-	12,448	504,909.62	1,012,271.36	-
002353	杰瑞股份	20150527	重大事项	35.05	-	-	28,238	856,493.68	989,741.90	-
000778	新兴铸管	20150615	重大事项	10.16	-	-	95,482	575,116.76	970,097.12	-
600978	宜华木业	20150618	重大事项	18.59	-	-	51,797	406,282.29	962,906.23	-
000839	中信国安	20150629	重大事项	23.57	-	-	39,926	424,412.83	941,055.82	-
600410	华胜天成	20150528	重大事项	34.36	20150722	43.06	25,254	517,075.99	867,727.44	-
600872	中炬高新	20150504	重大事项	23.16	-	-	37,456	387,505.61	867,480.96	-
002292	奥飞动漫	20150518	重大事项	37.29	-	-	23,178	343,024.55	864,307.62	-
601718	际华集团	20150617	重大事项	12.54	20150702	13.61	67,443	429,268.76	845,735.22	-
600654	中安消	20150629	重大事项	30.91	-	-	27,149	287,504.85	839,175.59	-
002223	鱼跃医疗	20150625	重大事项	67.20	20150713	60.48	12,361	364,761.77	830,659.20	-
600879	航天电子	20150515	重大事项	23.59	-	-	34,524	542,050.03	814,421.16	-
000566	海南海药	20150618	重大事项	40.75	-	-	19,144	473,970.96	780,118.00	-
000748	长城	20150618	重大	27.25	-	-	28,512	636,892.24	776,952.00	-

	信息		事项							
000592	平潭发展	20150630	重大事项	29.76	20150714	30.00	25,100	983,823.71	746,976.00	-
600643	爱建股份	20150630	重大事项	16.73	-	-	42,561	442,547.98	712,045.53	-
002276	万马股份	20150630	重大事项	34.15	20150720	30.74	20,049	299,180.62	684,673.35	-
002018	华信国际	20150615	重大事项	32.85	-	-	20,800	755,248.00	683,280.00	-
002310	东方园林	20150527	重大事项	28.57	-	-	23,733	430,149.91	678,051.81	-
600110	中科英华	20150626	重大事项	13.73	-	-	48,685	357,413.58	668,445.05	-
600175	美都能源	20150629	重大事项	10.64	20150720	9.58	62,316	377,634.66	663,042.24	-
300144	宋城演艺	20150618	重大事项	56.66	20150720	68.82	11,700	989,018.10	662,922.00	-
000963	华东医药	20150626	重大事项	71.48	20150805	69.20	9,272	501,632.41	662,762.56	-
601021	春秋航空	20150626	重大事项	126.09	20150721	113.48	5,200	631,702.28	655,668.00	-
601633	长城汽车	20150619	重大事项	36.70	20150713	38.50	17,675	720,093.87	648,672.50	-
000878	云南铜业	20150608	重大事项	18.54	-	-	34,498	481,871.59	639,592.92	-
600967	北方创业	20150413	重大事项	20.85	-	-	30,568	420,278.32	637,342.80	-
002191	劲嘉股份	20150618	重大事项	15.77	-	-	40,116	365,958.04	632,629.32	-
601216	内蒙君正	20150629	重大事项	24.07	20150702	24.20	26,116	358,658.84	628,612.12	-
600312	平高电气	20150623	重大事项	20.88	-	-	29,854	501,886.91	623,351.52	-
600277	亿利能源	20150601	重大事项	12.74	-	-	48,886	424,213.44	622,807.64	-
600499	科达洁能	20150610	重大事项	22.85	-	-	26,133	532,823.62	597,139.05	-
000887	中鼎股份	20150630	重大事项	24.75	-	-	23,677	413,539.00	586,005.75	-
600587	新华医疗	20150522	重大事项	50.16	20150703	52.77	11,226	360,142.84	563,096.16	-
002375	亚厦股份	20150617	重大事项	23.96	20150720	26.29	23,493	300,419.79	562,892.28	-
000786	北新	20150410	重大	19.13	-	-	26,324	226,259.49	503,578.12	-

	建材		事项							
001696	宗申动力	20150630	重大事项	17.25	20150824	15.53	29,182	316,880.97	503,389.50	-
000066	长城电脑	20150618	重大事项	16.84	-	-	29,014	252,437.63	488,595.76	-
000539	粤电力A	20150608	重大事项	10.81	20150721	10.75	43,320	462,451.00	468,289.20	-
000959	首钢股份	20150423	重大事项	6.19	-	-	74,405	297,548.46	460,566.95	-
300291	华录百纳	20150630	重大事项	37.76	20150713	34.65	12,100	546,265.90	456,896.00	-
002368	太极股份	20150514	重大事项	52.73	-	-	8,658	247,926.86	456,536.34	-
002269	美邦服饰	20150522	重大事项	11.29	20150702	10.67	40,120	171,712.89	452,954.80	-
600482	风帆股份	20150528	重大事项	35.79	-	-	12,590	163,858.85	450,596.10	-
000732	泰禾集团	20150625	重大事项	34.20	20150702	30.78	12,976	231,002.38	443,779.20	-
000979	中弘股份	20150525	重大事项	5.65	-	-	77,865	203,482.53	439,937.25	-
600366	宁波韵升	20150522	重大事项	30.71	20150812	31.58	14,269	226,848.96	438,200.99	-
002106	莱宝高科	20150407	重大事项	18.93	-	-	23,046	295,290.54	436,260.78	-
000650	仁和药业	20150612	重大事项	13.39	-	-	32,472	257,882.25	434,800.08	-
601311	骆驼股份	20150618	重大事项	23.31	20150715	25.38	18,642	296,491.81	434,545.02	-
002665	首航节能	20150630	重大事项	27.70	20150701	30.00	15,545	323,160.84	430,596.50	-
000543	皖能电力	20150615	重大事项	18.52	20150714	19.22	23,091	315,510.88	427,645.32	-
002325	洪涛股份	20150603	重大事项	23.87	-	-	17,822	191,406.77	425,411.14	-
002308	威创股份	20150612	重大事项	23.15	-	-	18,300	428,302.94	423,645.00	-
000697	炼石有色	20150518	重大事项	34.15	-	-	11,698	237,245.03	399,486.70	-
002001	新和成	20150630	重大事项	17.09	20150713	18.49	23,153	352,831.18	395,684.77	-
002414	高德红外	20150513	重大事项	39.32	-	-	9,921	228,099.08	390,093.72	-
000669	金鸿	20150504	重大	41.73	20150723	33.95	8,846	255,472.48	369,143.58	-

	能源		事项							
600790	轻纺城	20150525	重大事项	12.40	20150818	12.04	28,940	179,982.18	358,856.00	-
000510	*ST金路	20150119	重大事项	9.13	20150624	6.09	34,906	190,743.20	318,691.78	-
002309	中利科技	20150602	重大事项	27.95	20150721	30.05	11,305	212,848.92	315,974.75	-
002345	潮宏基	20150522	重大事项	17.94	-	-	17,482	145,519.88	313,627.08	-
600416	湘电股份	20150522	重大事项	17.95	20150720	20.35	16,957	206,154.66	304,378.15	-
600395	盘江股份	20150609	重大事项	13.05	20150819	14.00	23,286	190,743.53	303,882.30	-
002727	一心堂	20150413	重大事项	82.62	20150817	70.42	3,645	149,496.51	301,149.90	-
600702	沱牌舍得	20150629	重大事项	26.11	20150820	28.00	11,492	225,691.65	300,056.12	-
000850	华茂股份	20150507	重大事项	12.38	-	-	23,333	179,504.71	288,862.54	-
600387	海越股份	20150602	重大事项	23.02	20150630	25.52	12,536	196,370.91	288,578.72	-
002416	爱施德	20150505	重大事项	20.99	20150729	18.60	12,922	139,865.62	271,232.78	-
600869	智慧能源	20150511	重大事项	32.06	20150731	26.23	8,267	73,080.99	265,040.02	-
000788	北大医药	20150525	重大事项	18.39	20150721	18.65	14,289	200,421.42	262,774.71	-
002203	海亮股份	20150427	重大事项	11.82	-	-	21,942	134,524.12	259,354.44	-
600335	国机汽车	20150615	重大事项	27.62	20150721	34.14	8,312	176,633.73	229,577.44	-
000688	建新矿业	20150610	重大事项	14.02	-	-	15,976	136,937.08	223,983.52	-
002461	珠江啤酒	20150604	重大事项	25.67	20150724	23.76	8,105	106,053.92	208,055.35	-
002242	九阳股份	20150615	重大事项	15.25	20150707	17.51	13,517	155,900.80	206,134.25	-
002194	武汉凡谷	20150618	重大事项	21.08	20150724	24.28	9,706	141,278.38	204,602.48	-
002069	獐子岛	20150601	重大事项	17.94	-	-	11,385	133,972.46	204,246.90	-
002091	江苏国泰	20150601	重大事项	22.44	-	-	8,653	140,467.06	194,173.32	-
000519	江南	20150615	重大	19.81	-	-	9,675	145,963.69	191,661.75	-

002574	红箭 明牌 珠宝	20150604	重大 事项	17.97	-	-	10,417	106,139.02	187,193.49	-
002238	天威 视讯	20150629	重大 事项	23.76	-	-	6,636	93,197.90	157,671.36	-
002557	洽洽 食品	20150629	重大 事项	16.38	20150824	14.74	8,767	125,970.62	143,603.46	-
600333	长春 燃气	20150529	重大 事项	11.47	20150709	10.77	10,555	82,856.75	121,065.85	-
002662	京威 股份	20150515	重大 事项	17.82	20150813	16.06	6,389	66,952.13	113,851.98	-
002143	印纪 传媒	20150630	重大 事项	32.01	20150701	33.50	3,300	127,993.63	105,633.00	-
000693	华泽 钴镍	20150630	重大 事项	20.57	20150818	22.63	3,307	74,690.73	68,024.99	-

注：1、本基金截至 2015 年 6 月 30 日持有的海越股份、*ST 金路已于本期末复牌，但交易仍不活跃、流通仍受限，因此仍作为流通受限股票。2、本基金截至 2015 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，原则上采用复制指数投资策略，按照个股在基准指数中的基准权重构建股票组合，并根据基准指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪基准指数。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，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、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控制管理委员会，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与风险管理部负责，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。

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，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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中国建设银行，因而与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，且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%，因此不存在重大信用风险。

6.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市, 因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外, 其余均可以合理的价格适时变现。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位: 人民币元

本期末 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	53,171,532.33	-	-	-	53,171,532.33

存出保证金	220,137.48	-	-	-	220,137.48
交易性金融资产	-	-	91,545.30	674,564,942.48	674,656,487.78
应收利息	-	-	-	11,107.95	11,107.95
应收申购款	-	-	-	50,198.23	50,198.23
资产总计	53,391,669.81	-	91,545.30	674,626,248.66	728,109,463.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,215,716.43	3,215,716.43
应付管理人报酬	-	-	-	705,013.08	705,013.08
应付托管费	-	-	-	155,102.87	155,102.87
应付交易费用	-	-	-	508,709.10	508,709.10
其他负债	-	-	-	1,309,686.24	1,309,686.24
负债总计	-	-	-	5,894,227.72	5,894,227.72
利率敏感度缺口	53,391,669.81	-	91,545.30	668,732,020.94	722,215,236.05

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。

6.4.13.4.1.2 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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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，以复制、跟踪中证 800 指数为原则，进行指数化长期投资，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 90%—95%，其中投资于中证 800 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种，其中权证资产占基金

资产净值的比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	674,564,942.48	93.40
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	674,564,942.48	93.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2015 年 6 月 30 日，本基金运营不满一年，无经验数据分析本期末的其他价格风险敏感性。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 614,556,874.52 元，属于第二层次的余额为 60,099,613.26 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活

跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。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),本基金于 2015 年 3 月 24 日起改为采用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(附注 6.4.5.2),并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告 (转型前)

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	905,097,866.59	91.40
	其中:股票	905,097,866.59	91.40
2	固定收益投资	628,042.10	0.06
	其中:债券	628,042.10	0.06
	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	38,034,965.95	3.84
7	其他资产	46,449,932.33	4.69
8	合计	990,210,806.97	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,144,984.39	0.53
B	采矿业	33,763,764.49	3.47
C	制造业	364,635,186.54	37.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,584,579.21	2.84

E	建筑业	40,606,101.99	4.17
F	批发和零售业	35,498,847.15	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	26,841,133.74	2.76
H	住宿和餐饮业	96,748.56	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,764,867.81	5.53
J	金融业	211,392,082.35	21.73
K	房地产业	43,285,673.68	4.45
L	租赁和商务服务业	14,460,999.82	1.49
M	科学研究和技术服务业	1,235,588.48	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	7,141,544.88	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	718,514.16	0.07
R	文化、体育和娱乐业	11,687,185.67	1.20
S	综合	5,287,415.45	0.54
	合计	883,145,218.37	90.78

7.2.2 报告期末积极投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	9,385,075.76	0.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	157,877.76	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,398,863.70	0.25
J	金融业	1,535,191.70	0.16
K	房地产业	8,475,639.30	0.87
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	21,952,648.22	2.26

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

7.3.1 期末指数投资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	279,502	24,204,873.20	2.49
2	600036	招商银行	963,240	17,492,438.40	1.80
3	600016	民生银行	1,581,950	16,420,641.00	1.69
4	600030	中信证券	459,434	14,844,312.54	1.53
5	600837	海通证券	472,242	12,826,092.72	1.32
6	601166	兴业银行	667,169	12,436,030.16	1.28
7	601766	中国中车	361,882	12,220,755.14	1.26
8	600000	浦发银行	653,612	11,320,559.84	1.16
9	601398	工商银行	1,786,633	9,290,491.60	0.95
10	601668	中国建筑	875,770	8,459,938.20	0.87
11	000651	格力电器	140,611	8,208,870.18	0.84
12	000002	万科A	566,394	8,014,475.10	0.82
13	601390	中国中铁	398,906	7,762,710.76	0.80
14	600519	贵州茅台	26,813	6,933,573.67	0.71
15	600887	伊利股份	178,955	6,784,184.05	0.70
16	601989	中国重工	428,917	6,613,900.14	0.68
17	601818	光大银行	1,226,872	6,404,271.84	0.66
18	000001	平安银行	399,893	6,314,310.47	0.65
19	601328	交通银行	916,219	6,156,991.68	0.63
20	601601	中国太保	183,471	6,149,947.92	0.63
21	000783	长江证券	333,294	5,805,981.48	0.60
22	601288	农业银行	1,516,350	5,580,168.00	0.57
23	002024	苏宁云商	258,896	5,139,085.60	0.53
24	600637	百视通	71,386	5,038,423.88	0.52
25	601688	华泰证券	163,641	4,974,686.40	0.51
26	002050	三花股份	350,566	4,893,901.36	0.50
27	600104	上汽集团	193,192	4,883,893.76	0.50
28	600048	保利地产	375,924	4,856,938.08	0.50
29	601169	北京银行	369,781	4,796,059.57	0.49
30	000776	广发证券	172,752	4,735,132.32	0.49
31	000333	美的集团	123,090	4,689,729.00	0.48
32	600999	招商证券	135,701	4,468,633.93	0.46
33	601006	大秦铁路	347,037	4,376,136.57	0.45
34	600050	中国联通	494,772	4,284,725.52	0.44
35	600015	华夏银行	259,867	4,014,945.15	0.41
36	601186	中国铁建	180,483	3,999,503.28	0.41

37	601088	中国神华	192,702	3,975,442.26	0.41
38	300059	东方财富	52,386	3,945,189.66	0.41
39	000063	中兴通讯	114,925	3,790,226.50	0.39
40	600570	恒生电子	28,942	3,769,116.66	0.39
41	600518	康美药业	90,143	3,707,581.59	0.38
42	600795	国电电力	549,642	3,704,587.08	0.38
43	000897	津滨发展	450,381	3,697,628.01	0.38
44	600900	长江电力	288,692	3,677,936.08	0.38
45	600383	金地集团	262,255	3,674,192.55	0.38
46	601377	兴业证券	212,722	3,552,457.40	0.37
47	601336	新华保险	56,382	3,473,131.20	0.36
48	600804	鹏博士	73,023	3,451,797.21	0.35
49	000625	长安汽车	139,460	3,341,461.60	0.34
50	601628	中国人寿	87,750	3,217,792.50	0.33
51	002415	海康威视	70,502	3,179,640.20	0.33
52	600010	包钢股份	467,749	3,133,918.30	0.32
53	600761	安徽合力	170,544	2,999,868.96	0.31
54	600111	北方稀土	127,099	2,993,181.45	0.31
55	000858	五粮液	110,669	2,942,688.71	0.30
56	601899	紫金矿业	547,006	2,931,952.16	0.30
57	600584	长电科技	123,300	2,902,482.00	0.30
58	300024	机器人	30,589	2,860,071.50	0.29
59	002450	康得新	44,275	2,823,859.50	0.29
60	600739	辽宁成大	83,721	2,802,141.87	0.29
61	002396	星网锐捷	48,749	2,778,205.51	0.29
62	600585	海螺水泥	116,922	2,775,728.28	0.29
63	601857	中国石油	227,031	2,774,318.82	0.29
64	000100	TCL 集团	441,177	2,761,768.02	0.28
65	000503	海虹控股	44,589	2,752,478.97	0.28
66	000768	中航飞机	77,694	2,742,598.20	0.28
67	600089	特变电工	151,536	2,741,286.24	0.28
68	000024	招商地产	71,507	2,736,572.89	0.28
69	600011	华能国际	245,473	2,673,200.97	0.27
70	600415	小商品城	168,624	2,671,004.16	0.27
71	600271	航天信息	32,427	2,665,499.40	0.27
72	601800	中国交建	137,252	2,662,688.80	0.27
73	002437	誉衡药业	71,792	2,645,535.20	0.27
74	600018	上港集团	265,861	2,629,365.29	0.27
75	600276	恒瑞医药	44,083	2,628,228.46	0.27
76	601618	中国中冶	285,038	2,599,546.56	0.27
77	600690	青岛海尔	89,078	2,597,514.48	0.27
78	000725	京东方 A	594,353	2,567,604.96	0.26

79	600109	国金证券	90,763	2,559,516.60	0.26
80	000069	华侨城 A	259,828	2,548,912.68	0.26
81	601669	中国电建	167,880	2,548,418.40	0.26
82	600998	九州通	81,463	2,491,953.17	0.26
83	601727	上海电气	114,958	2,479,644.06	0.25
84	600100	同方股份	102,608	2,462,592.00	0.25
85	600019	宝钢股份	288,259	2,427,140.78	0.25
86	600580	卧龙电气	120,969	2,419,380.00	0.25
87	600352	浙江龙盛	71,631	2,417,546.25	0.25
88	000413	东旭光电	198,254	2,402,838.48	0.25
89	600028	中国石化	324,568	2,375,837.76	0.24
90	600886	国投电力	198,365	2,360,543.50	0.24
91	600150	中国船舶	40,334	2,329,691.84	0.24
92	600705	中航资本	87,205	2,298,723.80	0.24
93	600759	洲际油气	132,196	2,297,566.48	0.24
94	601018	宁波港	224,802	2,290,732.38	0.24
95	600177	雅戈尔	96,492	2,283,000.72	0.23
96	600893	中航动力	34,187	2,246,427.77	0.23
97	601888	中国国旅	27,039	2,233,151.01	0.23
98	000538	云南白药	30,468	2,172,673.08	0.22
99	300027	华谊兄弟	50,704	2,158,976.32	0.22
100	600588	用友网络	41,033	2,157,104.81	0.22
101	600118	中国卫星	34,620	2,140,208.40	0.22
102	002594	比亚迪	29,084	2,117,606.04	0.22
103	002202	金风科技	89,824	2,082,120.32	0.21
104	000157	中联重科	257,000	2,081,700.00	0.21
105	600031	三一重工	177,829	2,080,599.30	0.21
106	000061	农产品	79,539	2,040,970.74	0.21
107	600029	南方航空	204,582	2,011,041.06	0.21
108	002065	东华软件	46,686	2,005,630.56	0.21
109	601555	东吴证券	78,874	2,004,188.34	0.21
110	601866	中海集运	184,981	1,984,846.13	0.20
111	000338	潍柴动力	62,102	1,980,432.78	0.20
112	600406	国电南瑞	85,084	1,979,904.68	0.20
113	600196	复星医药	67,003	1,953,807.48	0.20
114	300168	万达信息	15,513	1,939,125.00	0.20
115	002465	海格通信	48,729	1,937,465.04	0.20
116	600340	华夏幸福	65,490	1,912,962.90	0.20
117	600009	上海机场	56,404	1,894,610.36	0.19
118	002129	中环股份	58,776	1,889,648.40	0.19
119	000009	中国宝安	92,348	1,874,664.40	0.19
120	600221	海南航空	345,240	1,871,200.80	0.19

121	600256	广汇能源	182,860	1,867,000.60	0.19
122	000402	金融街	139,497	1,859,495.01	0.19
123	002673	西部证券	28,071	1,844,826.12	0.19
124	300070	碧水源	31,261	1,844,399.00	0.19
125	002304	洋河股份	19,011	1,821,634.02	0.19
126	600703	三安光电	69,924	1,811,730.84	0.19
127	601009	南京银行	104,116	1,804,330.28	0.19
128	600066	宇通客车	77,734	1,787,104.66	0.18
129	600535	天士力	36,281	1,777,769.00	0.18
130	300017	网宿科技	29,843	1,774,464.78	0.18
131	002081	金螳螂	54,195	1,762,963.35	0.18
132	600718	东软集团	50,407	1,754,667.67	0.18
133	600839	四川长虹	215,252	1,745,693.72	0.18
134	601988	中国银行	393,174	1,745,692.56	0.18
135	002241	歌尔声学	44,618	1,729,839.86	0.18
136	000623	吉林敖东	42,026	1,710,037.94	0.18
137	600153	建发股份	99,705	1,700,967.30	0.17
138	000686	东北证券	68,705	1,657,164.60	0.17
139	600674	川投能源	64,381	1,648,797.41	0.17
140	601607	上海医药	56,037	1,630,676.70	0.17
141	300124	汇川技术	27,468	1,627,204.32	0.17
142	000423	东阿阿胶	30,515	1,620,651.65	0.17
143	600060	海信电器	45,685	1,597,604.45	0.16
144	600369	西南证券	65,861	1,596,470.64	0.16
145	002236	大华股份	34,186	1,592,042.02	0.16
146	000060	中金岭南	84,312	1,569,889.44	0.16
147	600309	万华化学	63,291	1,564,553.52	0.16
148	000895	双汇发展	58,237	1,543,280.50	0.16
149	002500	山西证券	58,994	1,516,145.80	0.16
150	600867	通化东宝	46,315	1,510,332.15	0.16
151	002385	大北农	74,107	1,496,220.33	0.15
152	000917	电广传媒	41,338	1,492,301.80	0.15
153	002008	大族激光	49,521	1,482,163.53	0.15
154	000826	桑德环境	29,602	1,450,498.00	0.15
155	002456	欧菲光	36,242	1,447,143.06	0.15
156	600583	海油工程	103,543	1,438,212.27	0.15
157	600252	中恒集团	54,386	1,436,334.26	0.15
158	002183	怡亚通	23,358	1,424,604.42	0.15
159	600315	上海家化	31,433	1,421,085.93	0.15
160	601099	太平洋	97,669	1,408,386.98	0.14
161	601179	中国西电	119,364	1,403,720.64	0.14
162	000793	华闻传媒	69,395	1,398,309.25	0.14

163	000039	中集集团	50,319	1,378,237.41	0.14
164	600489	中金黄金	91,170	1,377,578.70	0.14
165	600741	华域汽车	64,015	1,376,962.65	0.14
166	600079	人福医药	31,065	1,373,694.30	0.14
167	002405	四维图新	19,243	1,347,010.00	0.14
168	600660	福耀玻璃	81,993	1,326,646.74	0.14
169	600642	申能股份	132,891	1,319,607.63	0.14
170	600655	豫园商城	62,502	1,315,042.08	0.14
171	601933	永辉超市	114,108	1,314,524.16	0.14
172	601117	中国化学	115,625	1,308,875.00	0.13
173	600597	光明乳业	44,702	1,299,934.16	0.13
174	000630	铜陵有色	56,107	1,289,338.86	0.13
175	000581	威孚高科	34,699	1,271,371.36	0.13
176	002400	省广股份	40,656	1,271,313.12	0.13
177	600372	中航电子	30,985	1,270,694.85	0.13
178	600085	同仁堂	38,375	1,265,607.50	0.13
179	600547	山东黄金	41,734	1,263,288.18	0.13
180	000839	中信国安	54,871	1,251,607.51	0.13
181	000709	河北钢铁	248,306	1,248,979.18	0.13
182	601333	广深铁路	198,319	1,245,443.32	0.13
183	000629	攀钢钒钛	250,562	1,237,776.28	0.13
184	600645	中源协和	12,448	1,235,588.48	0.13
185	000559	万向钱潮	67,380	1,233,054.00	0.13
186	601168	西部矿业	111,145	1,228,152.25	0.13
187	000970	中科三环	49,794	1,224,932.40	0.13
188	300058	蓝色光标	33,949	1,221,485.02	0.13
189	002410	广联达	33,141	1,221,245.85	0.13
190	600115	东方航空	148,863	1,219,187.97	0.13
191	000831	五矿稀土	34,225	1,218,410.00	0.13
192	000800	一汽轿车	50,540	1,218,014.00	0.13
193	600208	新湖中宝	140,972	1,216,588.36	0.13
194	601098	中南传媒	42,033	1,188,272.91	0.12
195	002153	石基信息	7,429	1,184,925.50	0.12
196	600663	陆家嘴	23,910	1,179,480.30	0.12
197	601633	长城汽车	23,542	1,161,562.28	0.12
198	601111	中国国航	99,645	1,156,878.45	0.12
199	600516	方大炭素	71,403	1,135,307.70	0.12
200	600157	永泰能源	131,084	1,133,876.60	0.12
201	600875	东方电气	38,988	1,132,991.28	0.12
202	600316	洪都航空	25,096	1,118,026.80	0.11
203	002353	杰瑞股份	28,238	1,117,660.04	0.11
204	603000	人民网	16,265	1,108,134.45	0.11

205	000400	许继电气	35,404	1,107,437.12	0.11
206	002038	双鹭药业	16,094	1,105,818.74	0.11
207	600362	江西铜业	48,584	1,104,314.32	0.11
208	002007	华兰生物	17,192	1,101,663.36	0.11
209	600143	金发科技	89,885	1,099,293.55	0.11
210	600170	上海建工	103,799	1,094,041.46	0.11
211	600688	上海石化	127,682	1,090,404.28	0.11
212	002252	上海莱士	16,116	1,082,511.72	0.11
213	600108	亚盛集团	90,793	1,081,344.63	0.11
214	600827	百联股份	47,811	1,077,181.83	0.11
215	000960	锡业股份	47,127	1,071,667.98	0.11
216	002142	宁波银行	56,898	1,068,544.44	0.11
217	002470	金正大	18,329	1,067,664.25	0.11
218	600410	华胜天成	25,254	1,064,203.56	0.11
219	000598	兴蓉投资	104,426	1,060,968.16	0.11
220	600601	方正科技	86,901	1,058,454.18	0.11
221	600027	华电国际	124,077	1,058,376.81	0.11
222	600873	梅花生物	90,419	1,054,285.54	0.11
223	600895	张江高科	30,589	1,047,367.36	0.11
224	000568	泸州老窖	41,022	1,044,420.12	0.11
225	000792	盐湖股份	37,250	1,036,295.00	0.11
226	000750	国海证券	53,855	1,032,938.90	0.11
227	600037	歌华有线	27,773	1,012,603.58	0.10
228	300253	卫宁软件	12,552	1,006,544.88	0.10
229	000825	太钢不锈	132,858	1,000,420.74	0.10
230	600863	内蒙华电	169,160	992,969.20	0.10
231	600820	隧道股份	61,927	991,451.27	0.10
232	600498	烽火通信	28,318	986,882.30	0.10
233	600008	首创股份	64,198	986,081.28	0.10
234	000778	新兴铸管	127,603	979,991.04	0.10
235	601928	凤凰传媒	44,802	963,691.02	0.10
236	600978	宜华木业	51,197	958,407.84	0.10
237	600635	大众公用	51,928	949,243.84	0.10
238	600633	浙报传媒	34,778	944,222.70	0.10
239	600881	亚泰集团	74,631	944,082.15	0.10
240	600497	驰宏锌锗	58,331	940,879.03	0.10
241	000963	华东医药	12,698	934,572.80	0.10
242	600158	中体产业	26,717	932,423.30	0.10
243	600373	中文传媒	27,944	926,064.16	0.10
244	000729	燕京啤酒	81,821	925,395.51	0.10
245	000540	中天城投	67,087	925,129.73	0.10
246	000425	徐工机械	60,407	924,831.17	0.10

247	600600	青岛啤酒	20,430	923,231.70	0.09
248	601808	中海油服	34,710	914,608.50	0.09
249	300251	光线传媒	23,813	906,322.78	0.09
250	000876	新希望	36,371	906,001.61	0.09
251	600522	中天科技	29,792	904,783.04	0.09
252	002030	达安基因	15,119	904,418.58	0.09
253	600872	中炬高新	37,456	898,569.44	0.09
254	002344	海宁皮城	34,464	892,617.60	0.09
255	601929	吉视传媒	51,680	879,593.60	0.09
256	002292	奥飞动漫	11,589	878,214.42	0.09
257	600068	葛洲坝	70,254	878,175.00	0.09
258	002375	亚厦股份	20,929	876,925.10	0.09
259	601258	庞大集团	76,173	871,419.12	0.09
260	601898	中煤能源	106,740	869,931.00	0.09
261	000748	长城信息	25,812	864,702.00	0.09
262	000997	新大陆	14,347	860,963.47	0.09
263	600654	中安消	31,521	857,371.20	0.09
264	600201	金宇集团	11,351	856,432.95	0.09
265	600166	福田汽车	98,875	850,325.00	0.09
266	600879	航天电子	34,524	845,838.00	0.09
267	000998	隆平高科	27,625	842,286.25	0.09
268	600525	长园集团	33,949	839,219.28	0.09
269	002310	东方园林	23,733	829,468.35	0.09
270	600549	厦门钨业	25,380	828,910.80	0.09
271	000983	西山煤电	92,472	821,151.36	0.08
272	601608	中信重工	44,529	819,778.89	0.08
273	600021	上海电力	25,314	817,389.06	0.08
274	000566	海南海药	15,744	817,113.60	0.08
275	600797	浙大网新	43,372	813,225.00	0.08
276	000012	南玻A	52,072	812,323.20	0.08
277	000712	锦龙股份	17,807	807,547.45	0.08
278	601118	海南橡胶	68,762	805,890.64	0.08
279	600398	海澜之家	52,303	805,466.20	0.08
280	002570	贝因美	35,982	802,038.78	0.08
281	600435	北方导航	14,762	800,690.88	0.08
282	600169	太原重工	70,888	793,236.72	0.08
283	600643	爱建股份	30,716	791,858.48	0.08
284	601958	金铂股份	56,651	790,847.96	0.08
285	600436	片仔癀	4,810	788,407.10	0.08
286	000887	中鼎股份	23,377	784,298.35	0.08
287	001696	宗申动力	27,182	782,841.60	0.08
288	300146	汤臣倍健	15,593	782,612.67	0.08

289	000999	华润三九	22,824	780,124.32	0.08
290	600664	哈药股份	66,825	774,501.75	0.08
291	600765	中航重机	20,499	773,632.26	0.08
292	002603	以岭药业	26,590	769,514.60	0.08
293	600770	综艺股份	31,065	768,237.45	0.08
294	601872	招商轮船	74,513	767,483.90	0.08
295	002146	荣盛发展	36,287	766,381.44	0.08
296	000027	深圳能源	46,380	764,806.20	0.08
297	601992	金隅股份	63,370	761,073.70	0.08
298	002701	奥瑞金	24,460	760,216.80	0.08
299	000898	鞍钢股份	107,961	758,965.83	0.08
300	600038	中直股份	10,575	755,689.50	0.08
301	600122	宏图高科	36,457	747,003.93	0.08
302	002266	浙富控股	41,950	746,290.50	0.08
303	600967	北方创业	30,568	745,553.52	0.08
304	002475	立讯精密	14,665	739,262.65	0.08
305	600433	冠豪高新	32,803	739,051.59	0.08
306	002063	远光软件	14,744	738,969.28	0.08
307	002285	世联行	23,982	731,451.00	0.08
308	600058	五矿发展	25,254	731,103.30	0.08
309	600694	大商股份	11,689	730,679.39	0.08
310	600348	阳泉煤业	69,967	720,660.10	0.07
311	002424	贵州百灵	7,434	719,462.52	0.07
312	300015	爱尔眼科	15,197	718,514.16	0.07
313	300133	华策影视	22,391	717,631.55	0.07
314	601012	隆基股份	38,481	709,589.64	0.07
315	600267	海正药业	28,456	702,863.20	0.07
316	601699	潞安环能	53,825	693,266.00	0.07
317	000878	云南铜业	41,338	691,584.74	0.07
318	000078	海王生物	23,199	688,778.31	0.07
319	002294	信立泰	18,413	688,093.81	0.07
320	600811	东方集团	52,383	686,741.13	0.07
321	002022	科华生物	15,626	678,637.18	0.07
322	002001	新和成	33,753	677,422.71	0.07
323	601519	大智慧	25,534	676,906.34	0.07
324	600320	振华重工	65,640	675,435.60	0.07
325	600478	科力远	26,908	672,969.08	0.07
326	600528	中铁二局	28,672	665,190.40	0.07
327	601158	重庆水务	56,461	662,852.14	0.07
328	600648	外高桥	16,482	662,246.76	0.07
329	600380	健康元	24,267	662,246.43	0.07
330	002223	鱼跃医疗	11,561	661,289.20	0.07

331	600587	新华医疗	11,226	658,180.38	0.07
332	600578	京能电力	88,393	656,759.99	0.07
333	600880	博瑞传播	38,138	654,829.46	0.07
334	600755	厦门国贸	46,240	651,059.20	0.07
335	601718	际华集团	60,743	650,557.53	0.07
336	002276	万马股份	18,849	641,054.49	0.07
337	600737	中粮屯河	40,509	633,965.85	0.07
338	600499	科达洁能	22,133	626,806.56	0.06
339	600171	上海贝岭	21,220	626,626.60	0.06
340	300273	和佳股份	13,676	626,087.28	0.06
341	002221	东华能源	12,910	625,876.80	0.06
342	600151	航天机电	31,281	624,368.76	0.06
343	600312	平高电气	27,054	624,135.78	0.06
344	002368	太极股份	5,772	622,971.96	0.06
345	300134	大富科技	12,916	616,093.20	0.06
346	601216	内蒙君正	23,616	612,362.88	0.06
347	000656	金科股份	65,071	612,318.11	0.06
348	600685	中船防务	9,472	611,512.32	0.06
349	002399	海普瑞	14,151	608,351.49	0.06
350	002051	中工国际	18,004	604,574.32	0.06
351	002004	华邦颖泰	13,459	602,694.02	0.06
352	600783	鲁信创投	13,306	600,898.96	0.06
353	600200	江苏吴中	24,742	598,756.40	0.06
354	600277	亿利能源	48,886	594,942.62	0.06
355	000511	烯碳新材	45,448	584,006.80	0.06
356	002191	劲嘉股份	36,416	580,835.20	0.06
357	300147	香雪制药	14,132	580,542.56	0.06
358	000829	天音控股	26,264	580,434.40	0.06
359	600572	康恩贝	17,893	575,438.88	0.06
360	603288	海天味业	15,733	574,726.49	0.06
361	000415	渤海租赁	25,843	571,647.16	0.06
362	002161	远望谷	26,534	570,481.00	0.06
363	000786	北新建材	13,162	568,466.78	0.06
364	000661	长春高新	4,311	560,386.89	0.06
365	000587	金叶珠宝	18,123	559,457.01	0.06
366	000690	宝新能源	50,656	558,229.12	0.06
367	002429	兆驰股份	39,329	556,505.35	0.06
368	000401	冀东水泥	31,850	553,553.00	0.06
369	002073	软控股份	23,427	550,065.96	0.06
370	600266	北京城建	24,831	549,261.72	0.06
371	002340	格林美	31,423	547,388.66	0.06
372	000758	中色股份	23,338	543,542.02	0.06

373	002690	美亚光电	5,358	542,229.60	0.06
374	000816	江淮动力	33,321	539,133.78	0.06
375	002219	恒康医疗	12,314	538,121.80	0.06
376	002250	联化科技	22,746	532,483.86	0.05
377	600138	中青旅	20,067	530,972.82	0.05
378	000988	华工科技	24,691	526,905.94	0.05
379	600188	兖州煤业	34,620	523,800.60	0.05
380	002573	国电清新	10,714	521,986.08	0.05
381	600611	大众交通	28,831	519,534.62	0.05
382	600376	首开股份	37,609	517,499.84	0.05
383	000939	凯迪电力	29,818	517,342.30	0.05
384	600125	铁龙物流	35,746	517,244.62	0.05
385	000930	中粮生化	30,738	516,091.02	0.05
386	600187	国中水务	57,560	514,586.40	0.05
387	600787	中储股份	36,786	513,164.70	0.05
388	600219	南山铝业	45,685	512,128.85	0.05
389	002005	德豪润达	38,453	511,809.43	0.05
390	600675	中华企业	51,632	511,673.12	0.05
391	000671	阳光城	20,293	509,151.37	0.05
392	002489	浙江永强	12,280	509,128.80	0.05
393	000777	中核科技	10,634	508,305.20	0.05
394	603766	隆鑫通用	16,835	508,248.65	0.05
395	002048	宁波华翔	16,698	502,943.76	0.05
396	002325	洪涛股份	17,822	502,402.18	0.05
397	600198	大唐电信	14,151	502,218.99	0.05
398	600366	宁波韵升	14,269	500,699.21	0.05
399	002106	莱宝高科	23,046	498,715.44	0.05
400	600747	大连控股	54,104	498,297.84	0.05
401	600161	天坛生物	10,338	497,464.56	0.05
402	000718	苏宁环球	32,053	497,142.03	0.05
403	600317	营口港	76,548	495,265.56	0.05
404	600536	中国软件	9,784	493,700.64	0.05
405	002273	水晶光电	12,314	493,545.12	0.05
406	600110	中科英华	45,685	493,398.00	0.05
407	600511	国药股份	11,385	492,970.50	0.05
408	600835	上海机电	12,668	484,424.32	0.05
409	002390	信邦制药	8,983	484,183.70	0.05
410	600699	均胜电子	10,259	482,788.54	0.05
411	600521	华海药业	18,774	479,112.48	0.05
412	600517	置信电气	29,465	476,449.05	0.05
413	600816	安信信托	12,521	476,298.84	0.05
414	600651	飞乐音响	29,068	476,133.84	0.05

415	600064	南京高科	21,571	476,071.97	0.05
416	002269	美邦服饰	40,120	475,823.20	0.05
417	600582	天地科技	19,094	475,058.72	0.05
418	000066	长城电脑	26,114	470,835.42	0.05
419	000528	柳工	31,139	470,821.68	0.05
420	600175	美都能源	57,716	469,808.24	0.05
421	600557	康缘药业	13,756	466,328.40	0.05
422	600086	东方金钰	9,900	464,310.00	0.05
423	601000	唐山港	32,131	464,292.95	0.05
424	600485	信威集团	8,263	462,562.74	0.05
425	002358	森源电气	9,388	454,942.48	0.05
426	002595	豪迈科技	16,026	454,497.36	0.05
427	000536	华映科技	19,240	453,679.20	0.05
428	600062	华润双鹤	14,297	450,355.50	0.05
429	600289	亿阳信通	18,786	450,112.56	0.05
430	000959	首钢股份	74,405	448,662.15	0.05
431	600970	中材国际	20,962	448,377.18	0.05
432	002440	闰土股份	15,312	447,110.40	0.05
433	600180	瑞茂通	10,634	446,947.02	0.05
434	000937	冀中能源	47,683	445,359.22	0.05
435	600220	江苏阳光	56,355	442,386.75	0.05
436	300115	长盈精密	10,933	441,693.20	0.05
437	600112	天成控股	16,107	441,170.73	0.05
438	600884	杉杉股份	12,164	440,215.16	0.05
439	600481	双良节能	18,722	439,779.78	0.05
440	000555	神州信息	3,840	437,760.00	0.04
441	002092	中泰化学	38,375	437,091.25	0.04
442	600120	浙江东方	12,148	434,169.52	0.04
443	600438	通威股份	21,342	433,669.44	0.04
444	000006	深振业 A	37,367	431,588.85	0.04
445	300088	长信科技	13,455	430,560.00	0.04
446	300202	聚龙股份	8,896	427,897.60	0.04
447	000979	中弘股份	48,666	427,774.14	0.04
448	600270	外运发展	14,269	427,213.86	0.04
449	002271	东方雨虹	8,343	426,994.74	0.04
450	002665	首航节能	13,945	425,880.30	0.04
451	000062	深圳华强	9,483	425,502.21	0.04
452	000031	中粮地产	35,746	423,590.10	0.04
453	600545	新疆城建	21,600	422,064.00	0.04
454	601311	骆驼股份	16,942	421,686.38	0.04
455	600805	悦达投资	26,835	421,577.85	0.04
456	002179	中航光电	9,093	421,187.76	0.04

457	000050	深天马 A	14,801	420,052.38	0.04
458	600216	浙江医药	25,709	419,313.79	0.04
459	002477	雏鹰农牧	19,499	419,033.51	0.04
460	601002	晋亿实业	18,933	416,336.67	0.04
461	000667	美好集团	70,125	415,841.25	0.04
462	000732	泰禾集团	12,076	415,414.40	0.04
463	600482	风帆股份	12,590	414,211.00	0.04
464	600067	冠城大通	32,724	411,340.68	0.04
465	000652	泰达股份	40,726	411,332.60	0.04
466	002444	巨星科技	16,869	409,579.32	0.04
467	000869	张裕 A	8,004	408,764.28	0.04
468	300039	上海凯宝	21,176	402,344.00	0.04
469	002508	老板电器	9,587	401,695.30	0.04
470	000028	国药一致	4,903	399,153.23	0.04
471	002251	步步高	12,017	398,483.72	0.04
472	600176	中国巨石	15,404	398,193.40	0.04
473	000685	中山公用	12,373	398,163.14	0.04
474	000513	丽珠集团	4,518	397,538.82	0.04
475	002093	国脉科技	19,194	396,931.92	0.04
476	000697	炼石有色	11,698	395,977.30	0.04
477	002428	云南锗业	18,004	395,907.96	0.04
478	600426	华鲁恒升	26,370	395,286.30	0.04
479	600259	广晟有色	6,064	394,220.64	0.04
480	002698	博实股份	5,345	392,750.60	0.04
481	600790	轻纺城	28,940	392,715.80	0.04
482	002414	高德红外	9,921	390,688.98	0.04
483	600017	日照港	60,623	390,412.12	0.04
484	000090	天健集团	15,277	387,271.95	0.04
485	601717	郑煤机	35,746	387,129.18	0.04
486	600395	盘江股份	29,356	386,912.08	0.04
487	002653	海思科	12,590	386,638.90	0.04
488	002311	海大集团	16,957	385,093.47	0.04
489	600422	昆药集团	10,772	383,914.08	0.04
490	600416	湘电股份	16,957	383,906.48	0.04
491	600325	华发股份	25,709	382,035.74	0.04
492	600023	浙能电力	46,161	379,443.42	0.04
493	600673	东阳光科	39,353	379,362.92	0.04
494	600183	生益科技	33,603	377,361.69	0.04
495	600757	长江传媒	23,892	377,015.76	0.04
496	002317	众生药业	12,541	376,982.46	0.04
497	600614	鼎立股份	11,726	376,756.38	0.04
498	002551	尚荣医疗	7,675	374,002.75	0.04

499	000969	安泰科技	24,882	373,976.46	0.04
500	000931	中关村	22,715	372,980.30	0.04
501	002244	滨江集团	21,382	372,902.08	0.04
502	002422	科伦药业	8,161	371,733.55	0.04
503	600260	凯乐科技	18,503	371,170.18	0.04
504	000975	银泰资源	17,194	370,186.82	0.04
505	000973	佛塑科技	35,622	368,687.70	0.04
506	601010	文峰股份	22,440	367,118.40	0.04
507	002237	恒邦股份	23,330	366,747.60	0.04
508	000021	深科技	24,421	366,315.00	0.04
509	000099	中信海直	16,799	365,882.22	0.04
510	000961	中南建设	14,070	365,397.90	0.04
511	600825	新华传媒	20,691	364,989.24	0.04
512	000488	晨鸣纸业	35,491	364,847.48	0.04
513	600160	巨化股份	35,638	364,576.74	0.04
514	600284	浦东建设	21,820	364,394.00	0.04
515	000541	佛山照明	20,850	362,373.00	0.04
516	002122	天马股份	29,824	356,993.28	0.04
517	600006	东风汽车	33,318	356,835.78	0.04
518	600628	新世界	20,055	355,976.25	0.04
519	600432	吉恩镍业	19,138	354,435.76	0.04
520	600351	亚宝药业	24,692	353,095.60	0.04
521	000735	罗牛山	34,462	352,890.88	0.04
522	600809	山西汾酒	15,356	349,963.24	0.04
523	600409	三友化工	36,799	349,222.51	0.04
524	000510	*ST 金路	34,906	349,060.00	0.04
525	600894	广日股份	13,676	348,738.00	0.04
526	000088	盐田港	30,589	348,102.82	0.04
527	000933	神火股份	45,210	347,664.90	0.04
528	002672	东江环保	5,578	346,895.82	0.04
529	002727	一心堂	3,645	346,457.25	0.04
530	600993	马应龙	9,252	345,839.76	0.04
531	600098	广州发展	32,088	345,266.88	0.04
532	000669	金鸿能源	8,846	345,082.46	0.04
533	000636	风华高科	24,936	344,615.52	0.04
534	002029	七匹狼	18,110	343,727.80	0.04
535	000848	承德露露	12,052	343,482.00	0.04
536	002345	潮宏基	17,482	342,297.56	0.04
537	000543	皖能电力	20,691	341,815.32	0.04
538	002505	大康牧业	34,303	341,657.88	0.04
539	002332	仙琚制药	14,132	341,287.80	0.04
540	600261	阳光照明	22,984	340,393.04	0.03

541	000650	仁和药业	23,338	338,401.00	0.03
542	600056	中国医药	16,662	338,071.98	0.03
543	002249	大洋电机	23,600	337,480.00	0.03
544	600496	精工钢构	16,107	334,542.39	0.03
545	600851	海欣股份	23,358	333,785.82	0.03
546	000830	鲁西化工	40,884	332,386.92	0.03
547	000572	海马汽车	39,184	331,496.64	0.03
548	601369	陕鼓动力	25,709	331,131.92	0.03
549	002013	中航机电	8,643	329,557.59	0.03
550	600885	宏发股份	8,558	329,397.42	0.03
551	002309	中利科技	11,305	327,505.85	0.03
552	601886	江河创建	18,160	327,061.60	0.03
553	002431	棕榈园林	9,172	326,981.80	0.03
554	000422	湖北宜化	35,332	324,701.08	0.03
555	000850	华茂股份	23,333	322,928.72	0.03
556	601666	平煤股份	46,594	322,430.48	0.03
557	000762	西藏矿业	15,288	319,977.84	0.03
558	000550	江铃汽车	8,263	319,778.10	0.03
559	600750	江中药业	7,217	319,713.10	0.03
560	002277	友阿股份	15,764	319,693.92	0.03
561	002588	史丹利	9,084	318,303.36	0.03
562	002064	华峰氨纶	16,761	318,291.39	0.03
563	002299	圣农发展	18,083	316,633.33	0.03
564	600026	中海发展	24,938	316,213.84	0.03
565	002011	盾安环境	16,640	316,160.00	0.03
566	600596	新安股份	21,678	316,065.24	0.03
567	600831	广电网络	15,515	314,644.20	0.03
568	600859	王府井	9,172	314,049.28	0.03
569	600826	兰生股份	8,476	312,849.16	0.03
570	002416	爱施德	12,922	312,453.96	0.03
571	002371	七星电子	7,057	311,919.40	0.03
572	601880	大连港	39,622	310,636.48	0.03
573	002052	同洲电子	18,774	310,334.22	0.03
574	000877	天山股份	24,188	310,332.04	0.03
575	600300	维维股份	33,178	308,223.62	0.03
576	600387	海越股份	12,536	307,884.16	0.03
577	002028	思源电气	14,781	307,444.80	0.03
578	600850	华东电脑	3,916	307,053.56	0.03
579	002463	沪电股份	32,955	305,822.40	0.03
580	601001	大同煤业	33,257	305,299.26	0.03
581	600748	上实发展	18,332	305,227.80	0.03
582	600812	华北制药	32,586	304,679.10	0.03

583	600823	世茂股份	13,963	304,253.77	0.03
584	600509	天富能源	21,678	301,757.76	0.03
585	000788	北大医药	14,289	300,211.89	0.03
586	000563	陕国投 A	19,360	299,499.20	0.03
587	002384	东山精密	12,076	299,484.80	0.03
588	002041	登海种业	5,675	298,164.50	0.03
589	000926	福星股份	22,450	297,238.00	0.03
590	600073	上海梅林	19,800	296,802.00	0.03
591	600251	冠农股份	18,710	296,553.50	0.03
592	002293	罗莱家纺	4,549	295,230.10	0.03
593	000900	现代投资	28,318	294,790.38	0.03
594	002056	横店东磁	8,184	294,214.80	0.03
595	600546	山煤国际	39,046	294,016.38	0.03
596	002181	粤传媒	11,701	293,344.07	0.03
597	600460	士兰微	29,761	293,145.85	0.03
598	600869	智慧能源	8,267	291,163.74	0.03
599	002315	焦点科技	2,394	291,158.28	0.03
600	600736	苏州高新	24,938	290,777.08	0.03
601	600004	白云机场	18,265	290,413.50	0.03
602	002203	海亮股份	21,942	290,292.66	0.03
603	600776	东方通信	14,961	288,896.91	0.03
604	000049	德赛电池	4,903	287,806.10	0.03
605	002025	航天电器	7,875	287,201.25	0.03
606	002714	牧原股份	3,181	286,290.00	0.03
607	600864	哈投股份	12,906	285,609.78	0.03
608	002480	新筑股份	12,939	283,493.49	0.03
609	002408	齐翔腾达	10,896	282,969.12	0.03
610	600612	老凤祥	5,061	281,340.99	0.03
611	603555	贵人鸟	5,183	279,311.87	0.03
612	002216	三全食品	13,608	278,964.00	0.03
613	600337	美克家居	15,515	278,959.70	0.03
614	002140	东华科技	9,000	278,820.00	0.03
615	600720	祁连山	24,467	277,211.11	0.03
616	002254	泰和新材	14,073	276,956.64	0.03
617	002174	游族网络	2,711	273,214.58	0.03
618	601225	陕西煤业	27,816	272,874.96	0.03
619	600088	中视传媒	6,663	271,184.10	0.03
620	603077	和邦股份	12,076	270,502.40	0.03
621	600392	盛和资源	7,592	270,351.12	0.03
622	600401	海润光伏	20,829	269,527.26	0.03
623	601678	滨化股份	27,310	268,184.20	0.03
624	000417	合肥百货	21,817	267,040.08	0.03

625	600639	浦东金桥	10,496	267,018.24	0.03
626	000919	金陵药业	12,200	264,496.00	0.03
627	000726	鲁泰 A	17,820	262,488.60	0.03
628	600586	金晶科技	39,500	260,700.00	0.03
629	600132	重庆啤酒	9,626	260,479.56	0.03
630	600874	创业环保	17,253	258,622.47	0.03
631	600059	古越龙山	19,170	258,219.90	0.03
632	600657	信达地产	25,567	257,459.69	0.03
633	600702	沱牌舍得	10,692	255,431.88	0.03
634	002204	大连重工	15,197	255,005.66	0.03
635	000860	顺鑫农业	9,624	254,073.60	0.03
636	601231	环旭电子	6,297	253,958.01	0.03
637	600039	四川路桥	35,491	252,695.92	0.03
638	600239	云南城投	23,062	250,683.94	0.03
639	603699	纽威股份	8,896	250,422.40	0.03
640	600640	号百控股	8,737	249,616.09	0.03
641	601233	桐昆股份	12,005	242,621.05	0.02
642	000861	海印股份	14,073	242,055.60	0.02
643	000156	华数传媒	4,384	240,593.92	0.02
644	000886	海南高速	31,123	240,269.56	0.02
645	601908	京运通	10,496	239,623.68	0.02
646	600335	国机汽车	7,512	238,205.52	0.02
647	002240	威华股份	12,878	233,606.92	0.02
648	002342	巨力索具	22,430	233,496.30	0.02
649	601126	四方股份	6,593	229,436.40	0.02
650	002275	桂林三金	7,217	227,191.16	0.02
651	600280	中央商场	7,302	224,828.58	0.02
652	600292	中电远达	7,158	222,613.80	0.02
653	000852	江钻股份	6,504	221,005.92	0.02
654	600729	重庆百货	6,425	220,698.75	0.02
655	600456	宝钛股份	8,580	220,334.40	0.02
656	600141	兴发集团	12,497	219,947.20	0.02
657	600488	天药股份	22,905	219,658.95	0.02
658	000620	新华联	18,715	218,778.35	0.02
659	603993	洛阳钼业	13,986	218,601.18	0.02
660	002646	青青稞酒	7,217	217,592.55	0.02
661	600329	中新药业	8,658	217,402.38	0.02
662	601801	皖新传媒	7,354	216,428.22	0.02
663	600830	香溢融通	12,551	216,002.71	0.02
664	600298	安琪酵母	7,867	215,949.15	0.02
665	600439	瑞贝卡	25,973	215,835.63	0.02
666	600773	西藏城投	11,824	215,788.00	0.02

667	002069	獐子岛	11,385	214,948.80	0.02
668	002242	九阳股份	12,317	214,931.65	0.02
669	600551	时代出版	7,946	214,303.62	0.02
670	600563	法拉电子	5,436	214,069.68	0.02
671	002226	江南化工	7,888	213,370.40	0.02
672	601777	力帆股份	13,455	211,512.60	0.02
673	600636	三爱富	10,692	210,953.16	0.02
674	600425	青松建化	21,645	210,822.30	0.02
675	002078	太阳纸业	27,625	210,226.25	0.02
676	002503	搜于特	12,474	208,565.28	0.02
677	000418	小天鹅 A	8,892	207,894.96	0.02
678	002083	孚日股份	24,915	207,043.65	0.02
679	601566	九牧王	7,217	206,767.05	0.02
680	000809	铁岭新城	15,277	206,239.50	0.02
681	000030	富奥股份	15,197	206,223.29	0.02
682	601388	怡球资源	8,658	205,627.50	0.02
683	600740	山西焦化	23,872	205,299.20	0.02
684	000823	超声电子	12,668	204,461.52	0.02
685	002091	江苏国泰	8,653	202,566.73	0.02
686	600397	安源煤业	15,969	202,007.85	0.02
687	002281	光迅科技	3,294	201,592.80	0.02
688	002327	富安娜	13,700	199,472.00	0.02
689	600537	亿晶光电	9,469	198,375.55	0.02
690	600195	中牧股份	6,820	198,257.40	0.02
691	600997	开滦股份	24,316	196,230.12	0.02
692	601101	昊华能源	19,170	194,575.50	0.02
693	000927	一汽夏利	20,033	194,119.77	0.02
694	600616	金枫酒业	12,155	194,115.35	0.02
695	600199	金种子酒	15,449	193,730.46	0.02
696	002479	富春环保	11,464	193,626.96	0.02
697	002233	塔牌集团	14,211	191,564.28	0.02
698	000519	江南红箭	8,975	190,270.00	0.02
699	600507	方大特钢	21,099	187,359.12	0.02
700	000703	恒逸石化	13,519	187,238.15	0.02
701	600162	香江控股	17,915	187,032.60	0.02
702	002392	北京利尔	9,388	186,070.16	0.02
703	600467	好当家	17,649	185,843.97	0.02
704	603366	日出东方	6,504	185,429.04	0.02
705	002128	露天煤业	12,906	183,523.32	0.02
706	600510	黑牡丹	12,510	183,271.50	0.02
707	600971	恒源煤电	19,683	182,264.58	0.02
708	601515	东风股份	8,818	181,650.80	0.02

709	603005	晶方科技	2,869	180,058.44	0.02
710	002194	武汉凡谷	9,006	177,057.96	0.02
711	000921	海信科龙	14,269	176,650.22	0.02
712	000596	古井贡酒	4,708	176,455.84	0.02
713	600780	通宝能源	18,319	176,045.59	0.02
714	600468	百利电气	7,354	175,760.60	0.02
715	002393	力生制药	3,679	173,648.80	0.02
716	002612	朗姿股份	2,612	172,914.40	0.02
717	002557	洽洽食品	5,378	172,096.00	0.02
718	002238	天威视讯	4,766	171,433.02	0.02
719	000525	红太阳	7,867	168,983.16	0.02
720	000962	东方钽业	10,714	167,674.10	0.02
721	600078	澄星股份	15,673	165,506.88	0.02
722	600803	新奥股份	7,888	164,543.68	0.02
723	601965	中国汽研	7,730	163,412.20	0.02
724	600389	江山股份	3,994	163,234.78	0.02
725	002461	珠江啤酒	8,105	163,072.60	0.02
726	002574	明牌珠宝	10,417	161,463.50	0.02
727	000951	中国重汽	6,820	157,951.20	0.02
728	002648	卫星石化	9,388	157,812.28	0.02
729	600743	华远地产	21,225	157,701.75	0.02
730	601208	东材科技	12,076	156,988.00	0.02
731	002498	汉缆股份	9,058	156,431.66	0.02
732	000688	建新矿业	13,676	156,316.68	0.02
733	000631	顺发恒业	17,503	154,551.49	0.02
734	002635	安洁科技	5,598	154,448.82	0.02
735	600184	光电股份	5,054	153,944.84	0.02
736	603369	今世缘	3,994	152,690.62	0.02
737	002267	陕天然气	8,896	152,210.56	0.02
738	603001	奥康国际	4,903	149,688.59	0.02
739	600429	三元股份	14,073	148,329.42	0.02
740	601999	出版传媒	8,818	144,350.66	0.01
741	002678	珠江钢琴	7,571	141,426.28	0.01
742	002320	海峡股份	6,729	141,039.84	0.01
743	603328	依顿电子	3,916	135,924.36	0.01
744	002430	杭氧股份	9,942	135,211.20	0.01
745	600333	长春燃气	10,555	132,887.45	0.01
746	002225	濮耐股份	12,531	132,828.60	0.01
747	600197	伊力特	8,737	131,491.85	0.01
748	600618	氯碱化工	8,954	130,638.86	0.01
749	002490	山东墨龙	8,975	125,291.00	0.01
750	000603	盛达矿业	3,994	123,774.06	0.01

751	000780	平庄能源	15,848	123,614.40	0.01
752	000693	华泽钴镍	4,935	122,141.25	0.01
753	002419	天虹商场	6,266	121,247.10	0.01
754	002662	京威股份	6,389	115,896.46	0.01
755	601011	宝泰隆	6,266	108,965.74	0.01
756	000552	靖远煤电	8,658	104,242.32	0.01
757	600754	锦江股份	2,538	96,748.56	0.01
758	600801	华新水泥	7,602	95,405.10	0.01
759	002705	新宝股份	3,619	81,282.74	0.01

7.3.2 期末积极投资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	000627	天茂集团	363,290	5,463,881.60	0.56
2	600533	栖霞建设	598,178	4,276,972.70	0.44
3	000043	中航地产	344,153	4,198,666.60	0.43
4	002152	广电运通	75,582	3,921,194.16	0.40
5	002354	天神娱乐	15,786	1,791,711.00	0.18
6	000166	申万宏源	85,526	1,535,191.70	0.16
7	300051	三五互联	22,330	607,152.70	0.06
8	000906	物产中拓	5,392	157,877.76	0.02

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	601766	中国中车	5,258,915.95	0.51
2	600637	百视通	2,357,073.60	0.23
3	000166	申万宏源	575,598.96	0.06

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600998	九州通	109,513,728.26	10.59
2	601519	大智慧	20,096,973.63	1.94
3	601318	中国平安	9,890,111.76	0.96

4	300315	掌趣科技	9,828,956.87	0.95
5	600016	民生银行	7,226,636.26	0.70
6	600036	招商银行	7,064,074.22	0.68
7	600030	中信证券	6,445,215.20	0.62
8	600837	海通证券	5,161,353.64	0.50
9	601166	兴业银行	5,052,903.11	0.49
10	600000	浦发银行	4,753,896.09	0.46
11	601398	工商银行	3,953,758.92	0.38
12	000002	万科A	3,425,069.60	0.33
13	601668	中国建筑	3,048,991.91	0.29
14	000651	格力电器	2,932,192.57	0.28
15	601601	中国太保	2,851,541.36	0.28
16	601328	交通银行	2,727,633.95	0.26
17	600887	伊利股份	2,585,384.49	0.25
18	600519	贵州茅台	2,522,699.86	0.24
19	601288	农业银行	2,480,851.29	0.24
20	000001	平安银行	2,473,565.37	0.24

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	8,191,588.51
卖出股票收入（成交）总额	455,745,796.14

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	628,042.10	0.06
8	其他	-	-
9	合计	628,042.10	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序号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	113008	电气转债	2,870	628,042.10	0.06

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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。

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：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

1、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股中国平安。

根据 2014 年 12 月 8 日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2867 万元，并处以 440 万元

罚款。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

2、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股中信证券。

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

3、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

根据 2015 年 6 月 9 日兴业银行公告“2015 年 5 月中旬，公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报，该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案，目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组，就其涉及业务进行了全面内部排查，未发现银行资金卷入其中。目前，公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。”本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

4、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股海通证券。

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述情况外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	229,267.93
2	应收证券清算款	46,139,884.30
3	应收股利	-
4	应收利息	80,780.10
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,449,932.33

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

7.12.5.1 报告期末指数投资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	601766	中国中车	12,220,755.14	1.26	重大事项停牌

7.12.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告 (转型后)

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	674,564,942.48	92.65
	其中：股票	674,564,942.48	92.65
2	固定收益投资	91,545.30	0.01
	其中：债券	91,545.30	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	53,171,532.33	7.30
7	其他资产	281,443.66	0.04
8	合计	728,109,463.77	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
---	------	----------	---------------

码			
A	农、林、牧、渔业	4,258,586.45	0.59
B	采矿业	26,279,026.35	3.64
C	制造业	274,505,829.65	38.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,261,943.48	3.64
E	建筑业	25,209,869.20	3.49
F	批发和零售业	23,738,368.23	3.29
G	交通运输、仓储和邮政业	25,569,761.56	3.54
H	住宿和餐饮业	248,472.40	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,684,663.64	5.36
J	金融业	161,379,748.32	22.35
K	房地产业	34,442,446.47	4.77
L	租赁和商务服务业	10,319,062.51	1.43
M	科学研究和技术服务业	1,314,078.86	0.18
N	水利、环境和公共设施管理业	4,965,396.79	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,025,335.92	0.14
R	文化、体育和娱乐业	9,074,486.19	1.26
S	综合	4,263,758.36	0.59
	合计	671,540,834.38	92.98

7.2.2 积极投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	261,665.32	0.04
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,392,188.68	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	271,232.78	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,099,021.32	0.15
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,024,108.10	0.42

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细(转型后)

7.3.1 期末指数投资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	230,382	18,877,501.08	2.61
2	600036	招商银行	738,140	13,817,980.80	1.91
3	600016	民生银行	1,210,550	12,032,867.00	1.67
4	600000	浦发银行	535,912	9,089,067.52	1.26
5	600030	中信证券	337,134	9,072,275.94	1.26
6	601166	兴业银行	489,869	8,450,240.25	1.17
7	600837	海通证券	346,743	7,558,997.40	1.05
8	601398	工商银行	1,324,033	6,990,894.24	0.97
9	000651	格力电器	102,811	6,569,622.90	0.91
10	000002	万科A	409,794	5,950,208.88	0.82
11	601766	中国中车	317,882	5,836,313.52	0.81
12	601328	交通银行	673,719	5,551,444.56	0.77
13	601668	中国建筑	633,570	5,264,966.70	0.73
14	600519	贵州茅台	19,446	5,010,261.90	0.69
15	600887	伊利股份	263,034	4,971,342.60	0.69
16	601988	中国银行	996,174	4,871,290.86	0.67
17	601989	中国重工	320,660	4,745,768.00	0.66
18	601818	光大银行	855,272	4,584,257.92	0.63
19	601288	农业银行	1,137,137	4,218,778.27	0.58
20	000001	平安银行	289,693	4,212,136.22	0.58
21	601601	中国太保	134,971	4,073,424.78	0.56

22	601390	中国中铁	288,806	3,953,754.14	0.55
23	601169	北京银行	272,139	3,624,891.48	0.50
24	002050	三花股份	307,366	3,531,635.34	0.49
25	601006	大秦铁路	251,271	3,527,844.84	0.49
26	000166	申万宏源	212,426	3,451,922.50	0.48
27	000333	美的集团	89,979	3,354,417.12	0.46
28	300059	东方财富	50,186	3,166,234.74	0.44
29	600104	上汽集团	139,821	3,159,954.60	0.44
30	000783	长江证券	224,594	3,133,086.30	0.43
31	600048	保利地产	272,124	3,107,656.08	0.43
32	600015	华夏银行	190,167	2,892,440.07	0.40
33	000776	广发证券	126,968	2,875,825.20	0.40
34	002024	苏宁云商	187,196	2,864,098.80	0.40
35	601688	华泰证券	120,191	2,780,017.83	0.38
36	600795	国电电力	397,353	2,769,550.41	0.38
37	600900	长江电力	216,220	2,674,641.40	0.37
38	600999	招商证券	99,469	2,631,949.74	0.36
39	600050	中国联通	358,272	2,626,133.76	0.36
40	000024	招商地产	71,507	2,610,005.50	0.36
41	000858	五粮液	80,653	2,556,700.10	0.35
42	600011	华能国际	177,673	2,492,752.19	0.35
43	000768	中航飞机	56,236	2,450,764.88	0.34
44	600570	恒生电子	21,776	2,440,000.80	0.34
45	600383	金地集团	191,584	2,423,537.60	0.34
46	601857	中国石油	207,531	2,351,326.23	0.33
47	600518	康美药业	132,244	2,344,686.12	0.32
48	002415	海康威视	51,002	2,284,889.60	0.32
49	000725	京东方 A	437,837	2,272,374.03	0.31
50	600637	百视通	53,881	2,267,312.48	0.31
51	601628	中国人寿	70,547	2,209,532.04	0.31
52	600029	南方航空	151,182	2,198,186.28	0.30
53	600010	包钢股份	419,649	2,177,978.31	0.30
54	600886	国投电力	145,878	2,169,205.86	0.30
55	601336	新华保险	35,434	2,163,600.04	0.30
56	600703	三安光电	67,724	2,119,761.20	0.29
57	601377	兴业证券	154,609	2,116,597.21	0.29
58	601901	方正证券	175,300	2,084,317.00	0.29
59	000100	TCL 集团	366,686	2,071,775.90	0.29
60	000625	长安汽车	96,519	2,041,376.85	0.28

61	601186	中国铁建	130,151	2,034,260.13	0.28
62	300104	乐视网	39,100	2,023,816.00	0.28
63	000069	华侨城 A	154,498	2,005,384.04	0.28
64	000063	中兴通讯	83,645	1,991,587.45	0.28
65	600690	青岛海尔	64,486	1,955,860.38	0.27
66	600028	中国石化	274,468	1,937,744.08	0.27
67	600109	国金证券	79,292	1,934,724.80	0.27
68	601009	南京银行	84,516	1,926,964.80	0.27
69	000538	云南白药	22,164	1,912,088.28	0.26
70	600019	宝钢股份	211,659	1,849,899.66	0.26
71	600276	恒瑞医药	41,510	1,848,855.40	0.26
72	600585	海螺水泥	84,615	1,814,991.75	0.25
73	600415	小商品城	116,573	1,781,235.44	0.25
74	601088	中国神华	84,196	1,755,486.60	0.24
75	601899	紫金矿业	338,210	1,731,635.20	0.24
76	300024	机器人	22,389	1,729,774.14	0.24
77	600256	广汇能源	165,960	1,725,984.00	0.24
78	600111	北方稀土	92,983	1,686,711.62	0.23
79	600089	特变电工	110,965	1,643,391.65	0.23
80	600221	海南航空	253,406	1,619,264.34	0.22
81	601919	中国远洋	129,100	1,611,168.00	0.22
82	600100	同方股份	75,625	1,587,368.75	0.22
83	600839	四川长虹	156,790	1,542,813.60	0.21
84	002183	怡亚通	23,358	1,536,489.24	0.21
85	600271	航天信息	23,588	1,526,379.48	0.21
86	000157	中联重科	187,295	1,518,962.45	0.21
87	600150	中国船舶	29,265	1,507,147.50	0.21
88	000503	海虹控股	30,527	1,495,823.00	0.21
89	601618	中国中冶	205,806	1,487,977.38	0.21
90	002081	金螳螂	52,495	1,479,834.05	0.20
91	002450	康得新	48,067	1,470,850.20	0.20
92	600705	中航资本	63,130	1,461,459.50	0.20
93	000402	金融街	102,276	1,445,159.88	0.20
94	601018	宁波港	163,351	1,444,022.84	0.20
95	600118	中国卫星	25,101	1,429,752.96	0.20
96	000338	潍柴动力	44,809	1,418,652.94	0.20
97	600804	鹏博士	47,112	1,406,764.32	0.19
98	600196	复星医药	48,474	1,402,837.56	0.19
99	601669	中国电建	123,488	1,400,353.92	0.19

100	300027	华谊兄弟	36,704	1,399,890.56	0.19
101	600352	浙江龙盛	97,562	1,382,453.54	0.19
102	601099	太平洋	105,669	1,365,243.48	0.19
103	600340	华夏幸福	44,752	1,362,698.40	0.19
104	600588	用友网络	29,639	1,359,837.32	0.19
105	601106	中国一重	112,000	1,356,320.00	0.19
106	300017	网宿科技	28,943	1,343,534.06	0.19
107	600115	东方航空	108,937	1,342,103.84	0.19
108	002304	洋河股份	19,295	1,338,301.20	0.19
109	600893	中航动力	24,778	1,316,950.70	0.18
110	600535	天士力	26,387	1,313,017.12	0.18
111	002736	国信证券	52,100	1,307,189.00	0.18
112	600009	上海机场	40,904	1,296,656.80	0.18
113	601866	中海集运	136,353	1,295,353.50	0.18
114	600958	东方证券	44,700	1,279,314.00	0.18
115	600406	国电南瑞	61,691	1,276,386.79	0.18
116	000917	电广传媒	41,338	1,274,037.16	0.18
117	002202	金风科技	65,124	1,267,964.28	0.18
118	600031	三一重工	130,829	1,267,733.01	0.18
119	000709	河北钢铁	181,098	1,267,686.00	0.18
120	600739	辽宁成大	51,812	1,266,803.40	0.18
121	600153	建发股份	72,264	1,265,342.64	0.18
122	600583	海油工程	75,248	1,253,631.68	0.17
123	002230	科大讯飞	35,600	1,243,864.00	0.17
124	601727	上海电气	83,268	1,243,191.24	0.17
125	000423	东阿阿胶	22,287	1,214,641.50	0.17
126	600005	武钢股份	171,700	1,207,051.00	0.17
127	600177	雅戈尔	65,923	1,203,753.98	0.17
128	601333	广深铁路	145,796	1,198,443.12	0.17
129	002456	欧菲光	35,142	1,185,691.08	0.16
130	000629	攀钢钒钛	220,262	1,180,604.32	0.16
131	000039	中集集团	36,506	1,179,143.80	0.16
132	000061	农产品	57,529	1,173,591.60	0.16
133	000793	华闻传媒	69,395	1,172,081.55	0.16
134	601555	东吴证券	57,160	1,170,065.20	0.16
135	600674	川投能源	93,418	1,168,659.18	0.16
136	002241	歌尔声学	32,418	1,163,806.20	0.16
137	000630	铜陵有色	112,214	1,158,048.48	0.16
138	600066	宇通客车	56,334	1,157,663.70	0.16

139	600068	葛洲坝	98,354	1,149,758.26	0.16
140	002008	大族激光	39,921	1,146,531.12	0.16
141	300070	碧水源	22,861	1,115,388.19	0.15
142	002594	比亚迪	20,084	1,109,239.32	0.15
143	601111	中国国航	72,124	1,107,824.64	0.15
144	600023	浙能电力	111,561	1,106,685.12	0.15
145	600309	万华化学	45,765	1,106,597.70	0.15
146	601888	中国国旅	16,622	1,102,038.60	0.15
147	002465	海格通信	33,829	1,088,955.51	0.15
148	000559	万向钱潮	48,579	1,061,936.94	0.15
149	601800	中国交建	59,667	1,047,752.52	0.15
150	000060	中金岭南	56,268	1,046,022.12	0.14
151	600079	人福医药	28,165	1,043,513.25	0.14
152	601991	大唐发电	128,800	1,027,824.00	0.14
153	600863	内蒙华电	124,751	1,020,463.18	0.14
154	000623	吉林敖东	30,356	1,019,961.60	0.14
155	002673	西部证券	35,742	1,014,000.54	0.14
156	600645	中源协和	12,448	1,012,271.36	0.14
157	600027	华电国际	90,977	1,011,664.24	0.14
158	601933	永辉超市	86,567	1,003,311.53	0.14
159	600688	上海石化	93,451	1,002,729.23	0.14
160	600085	同仁堂	27,834	999,518.94	0.14
161	600157	永泰能源	144,491	994,098.08	0.14
162	002353	杰瑞股份	28,238	989,741.90	0.14
163	600315	上海家化	22,802	989,606.80	0.14
164	600219	南山铝业	96,785	976,560.65	0.14
165	600200	江苏吴中	26,542	975,418.50	0.14
166	600642	申能股份	97,368	974,653.68	0.13
167	000778	新兴铸管	95,482	970,097.12	0.13
168	000686	东北证券	49,702	967,697.94	0.13
169	000568	泸州老窖	29,653	966,984.33	0.13
170	300124	汇川技术	20,068	963,264.00	0.13
171	600978	宜华木业	51,797	962,906.23	0.13
172	600895	张江高科	32,789	954,487.79	0.13
173	600881	亚泰集团	74,931	952,373.01	0.13
174	000839	中信国安	39,926	941,055.82	0.13
175	600369	西南证券	47,796	939,191.40	0.13
176	600741	华域汽车	43,833	935,834.55	0.13
177	600037	歌华有线	29,673	934,699.50	0.13

178	600597	光明乳业	40,402	929,246.00	0.13
179	002065	东华软件	32,186	925,347.50	0.13
180	000540	中天城投	72,287	910,816.20	0.13
181	601607	上海医药	40,737	907,212.99	0.13
182	600737	中粮屯河	43,409	903,341.29	0.13
183	600252	中恒集团	39,241	902,543.00	0.12
184	601179	中国西电	87,475	896,618.75	0.12
185	000895	双汇发展	41,937	894,516.21	0.12
186	601898	中煤能源	77,761	888,030.62	0.12
187	601168	西部矿业	81,063	885,207.96	0.12
188	000009	中国宝安	53,843	878,179.33	0.12
189	002142	宁波银行	41,398	875,567.70	0.12
190	600663	陆家嘴	17,447	867,813.78	0.12
191	600410	华胜天成	25,254	867,727.44	0.12
192	002030	达安基因	19,583	867,526.90	0.12
193	600872	中炬高新	37,456	867,480.96	0.12
194	600875	东方电气	42,288	865,635.36	0.12
195	002292	奥飞动漫	23,178	864,307.62	0.12
196	000800	一汽轿车	34,539	859,330.32	0.12
197	600601	方正科技	93,601	851,769.10	0.12
198	600660	福耀玻璃	59,298	846,775.44	0.12
199	000046	泛海控股	57,800	846,770.00	0.12
200	601718	际华集团	67,443	845,735.22	0.12
201	002405	四维图新	19,243	842,843.40	0.12
202	300003	乐普医疗	20,700	839,799.00	0.12
203	600446	金证股份	6,800	839,528.00	0.12
204	600654	中安消	27,149	839,175.59	0.12
205	600018	上港集团	105,861	837,360.51	0.12
206	000826	桑德环境	21,457	834,462.73	0.12
207	002223	鱼跃医疗	12,361	830,659.20	0.12
208	601117	中国化学	84,117	822,664.26	0.11
209	600635	大众公用	83,992	821,441.76	0.11
210	600060	海信电器	33,385	820,937.15	0.11
211	600158	中体产业	28,617	819,877.05	0.11
212	600879	航天电子	34,524	814,421.16	0.11
213	300058	蓝色光标	50,951	805,535.31	0.11
214	600489	中金黄金	62,284	801,595.08	0.11
215	000998	隆平高科	29,525	800,127.50	0.11
216	000883	湖北能源	91,400	797,008.00	0.11

217	600208	新湖中宝	103,087	795,831.64	0.11
218	000425	徐工机械	59,907	794,965.89	0.11
219	002236	大华股份	24,886	794,361.12	0.11
220	600718	东软集团	36,359	790,081.07	0.11
221	600372	中航电子	22,508	786,204.44	0.11
222	600332	白云山	22,700	782,242.00	0.11
223	000581	威孚高科	25,209	781,226.91	0.11
224	000566	海南海药	19,144	780,118.00	0.11
225	000748	长城信息	28,512	776,952.00	0.11
226	600143	金发科技	65,021	775,050.32	0.11
227	002500	山西证券	42,694	772,334.46	0.11
228	002129	中环股份	38,876	769,356.04	0.11
229	300002	神州泰岳	50,377	767,745.48	0.11
230	002252	上海莱士	11,716	766,695.04	0.11
231	300033	同花顺	8,900	765,311.00	0.11
232	000792	盐湖股份	26,891	763,166.58	0.11
233	600362	江西铜业	35,235	757,904.85	0.10
234	000547	闽福发 A	28,200	752,376.00	0.10
235	600525	长园集团	36,549	751,812.93	0.10
236	000592	平潭发展	25,100	746,976.00	0.10
237	002400	省广股份	29,556	746,584.56	0.10
238	600547	山东黄金	30,160	744,952.00	0.10
239	000970	中科三环	36,110	744,227.10	0.10
240	600026	中海发展	57,838	742,639.92	0.10
241	000012	南玻 A	55,572	741,330.48	0.10
242	600320	振华重工	70,240	737,520.00	0.10
243	600201	金宇集团	10,351	736,163.12	0.10
244	600867	通化东宝	33,537	735,466.41	0.10
245	600376	首开股份	38,009	733,193.61	0.10
246	000598	兴蓉投资	76,078	728,066.46	0.10
247	000031	中粮地产	38,446	726,244.94	0.10
248	000997	新大陆	27,124	721,498.40	0.10
249	600435	北方导航	15,762	715,121.94	0.10
250	600643	爱建股份	42,561	712,045.53	0.10
251	600170	上海建工	75,851	711,482.38	0.10
252	002153	石基信息	5,429	705,715.71	0.10
253	300253	卫宁软件	13,552	704,704.00	0.10
254	601808	中海油服	25,142	702,467.48	0.10
255	000413	东旭光电	71,547	699,729.66	0.10

256	601098	中南传媒	30,495	698,640.45	0.10
257	600811	东方集团	56,283	693,969.39	0.10
258	600600	青岛啤酒	14,850	691,861.50	0.10
259	600594	益佰制药	11,900	691,747.00	0.10
260	000825	太钢不锈	97,189	691,013.79	0.10
261	600694	大商股份	12,489	690,391.92	0.10
262	002385	大北农	50,907	688,262.64	0.10
263	000960	锡业股份	34,155	688,223.25	0.10
264	600873	梅花生物	65,803	686,983.32	0.10
265	002276	万马股份	20,049	684,673.35	0.09
266	600655	豫园商城	42,610	683,890.50	0.09
267	002018	华信国际	20,800	683,280.00	0.09
268	600108	亚盛集团	65,870	682,413.20	0.09
269	600827	百联股份	32,676	679,987.56	0.09
270	002310	东方园林	23,733	678,051.81	0.09
271	600816	安信信托	13,521	673,616.22	0.09
272	002038	双鹭药业	11,825	669,886.25	0.09
273	600110	中科英华	48,685	668,445.05	0.09
274	000712	锦龙股份	19,007	667,145.70	0.09
275	600175	美都能源	62,316	663,042.24	0.09
276	300144	宋城演艺	11,700	662,922.00	0.09
277	000963	华东医药	9,272	662,762.56	0.09
278	600797	浙大网新	34,827	657,882.03	0.09
279	000750	国海证券	39,117	657,165.60	0.09
280	601021	春秋航空	5,200	655,668.00	0.09
281	300199	翰宇药业	20,200	653,066.00	0.09
282	601633	长城汽车	17,675	648,672.50	0.09
283	300147	香雪制药	21,052	648,401.60	0.09
284	000690	宝新能源	51,156	647,123.40	0.09
285	000738	中航动控	19,500	646,620.00	0.09
286	601012	隆基股份	41,081	646,614.94	0.09
287	600770	综艺股份	33,065	646,090.10	0.09
288	000400	许继电气	25,671	645,882.36	0.09
289	600169	太原重工	71,888	639,803.20	0.09
290	000878	云南铜业	34,498	639,592.92	0.09
291	600584	长电科技	33,468	639,573.48	0.09
292	000831	五矿稀土	24,969	638,707.02	0.09
293	600967	北方创业	30,568	637,342.80	0.09
294	002701	奥瑞金	24,460	636,693.80	0.09

295	600122	宏图高科	38,757	636,389.94	0.09
296	600787	中储股份	39,386	634,114.60	0.09
297	000983	西山煤电	66,750	632,790.00	0.09
298	002191	劲嘉股份	40,116	632,629.32	0.09
299	600316	洪都航空	18,259	631,396.22	0.09
300	601216	内蒙君正	26,116	628,612.12	0.09
301	000616	海航投资	60,400	626,952.00	0.09
302	600675	中华企业	55,332	625,804.92	0.09
303	600166	福田汽车	70,828	625,411.24	0.09
304	600312	平高电气	29,854	623,351.52	0.09
305	600277	亿利能源	48,886	622,807.64	0.09
306	300251	光线传媒	24,957	621,429.30	0.09
307	000027	深圳能源	50,284	621,007.40	0.09
308	600497	驰宏锌锗	42,438	619,170.42	0.09
309	603000	人民网	11,865	618,522.45	0.09
310	000729	燕京啤酒	59,406	617,822.40	0.09
311	002266	浙富控股	45,050	616,284.00	0.09
312	000930	中粮生化	32,638	615,226.30	0.09
313	600511	国药股份	12,185	614,002.15	0.09
314	600704	物产中大	25,400	606,552.00	0.08
315	601258	庞大集团	110,962	605,852.52	0.08
316	002146	荣盛发展	48,374	604,675.00	0.08
317	600651	飞乐音响	29,268	602,042.76	0.08
318	000511	烯碳新材	48,948	599,613.00	0.08
319	000661	长春高新	4,611	599,430.00	0.08
320	600499	科达洁能	26,133	597,139.05	0.08
321	600058	五矿发展	18,254	596,358.18	0.08
322	600125	铁龙物流	38,646	596,307.78	0.08
323	600008	首创股份	40,898	586,886.30	0.08
324	000887	中鼎股份	23,677	586,005.75	0.08
325	002219	恒康医疗	13,114	583,048.44	0.08
326	002073	软控股份	25,227	582,743.70	0.08
327	600522	中天科技	25,619	582,319.87	0.08
328	002022	科华生物	13,626	581,285.16	0.08
329	600436	片仔癀	8,697	579,828.99	0.08
330	600428	中远航运	35,800	579,602.00	0.08
331	002470	金正大	26,658	578,745.18	0.08
332	600021	上海电力	27,114	572,105.40	0.08
333	000898	鞍钢股份	78,358	572,013.40	0.08

334	300072	三聚环保	16,900	569,530.00	0.08
335	600685	中船防务	10,572	568,139.28	0.08
336	601608	中信重工	34,841	567,908.30	0.08
337	601929	吉视传媒	37,402	565,518.24	0.08
338	600759	洲际油气	36,907	563,938.96	0.08
339	600587	新华医疗	11,226	563,096.16	0.08
340	002375	亚厦股份	23,493	562,892.28	0.08
341	002410	广联达	24,041	562,559.40	0.08
342	300273	和佳股份	18,879	562,405.41	0.08
343	600171	上海贝岭	22,820	557,949.00	0.08
344	600500	中化国际	31,800	555,864.00	0.08
345	600755	厦门国贸	49,340	554,581.60	0.08
346	601928	凤凰传媒	32,390	553,869.00	0.08
347	600240	华业地产	36,100	550,886.00	0.08
348	601992	金隅股份	45,931	548,875.45	0.08
349	002007	华兰生物	12,392	548,841.68	0.08
350	002161	远望谷	25,034	544,739.84	0.08
351	002475	立讯精密	16,097	544,239.57	0.08
352	000006	深振业 A	40,067	543,709.19	0.08
353	600498	烽火通信	20,545	543,620.70	0.08
354	002250	联化科技	24,246	543,110.40	0.08
355	600808	马钢股份	102,000	542,640.00	0.08
356	000078	海王生物	24,599	541,178.00	0.07
357	300015	爱尔眼科	16,692	538,483.92	0.07
358	600373	中文传媒	22,427	537,350.92	0.07
359	600187	国中水务	68,760	536,328.00	0.07
360	600521	华海药业	17,074	533,562.50	0.07
361	600717	天津港	35,500	532,145.00	0.07
362	600198	大唐电信	14,951	529,863.44	0.07
363	300267	尔康制药	15,500	528,395.00	0.07
364	600017	日照港	65,023	527,336.53	0.07
365	002285	世联行	24,482	524,894.08	0.07
366	600426	华鲁恒升	28,270	524,691.20	0.07
367	600578	京能电力	58,675	523,967.75	0.07
368	000897	津滨发展	54,824	523,020.96	0.07
369	600348	阳泉煤业	50,967	522,411.75	0.07
370	601000	唐山港	38,131	522,013.39	0.07
371	600516	方大炭素	43,746	521,014.86	0.07
372	600317	营口港	82,548	520,052.40	0.07

373	002004	华邦颖泰	39,947	518,512.06	0.07
374	600528	中铁二局	30,872	517,723.44	0.07
375	000876	新希望	26,656	517,392.96	0.07
376	600086	东方金钰	9,600	516,192.00	0.07
377	600611	大众交通	30,931	515,001.15	0.07
378	000667	美好集团	76,525	514,248.00	0.07
379	600765	中航重机	18,599	510,170.57	0.07
380	002424	贵州百灵	8,134	508,863.04	0.07
381	000999	华润三九	16,724	508,242.36	0.07
382	002570	贝因美	26,182	508,192.62	0.07
383	600220	江苏阳光	61,055	506,145.95	0.07
384	000786	北新建材	26,324	503,578.12	0.07
385	001696	宗申动力	29,182	503,389.50	0.07
386	600325	华发股份	27,709	501,532.90	0.07
387	002489	浙江永强	13,280	500,656.00	0.07
388	000718	苏宁环球	34,653	500,042.79	0.07
389	002049	同方国芯	10,400	499,200.00	0.07
390	600517	置信电气	31,665	495,557.25	0.07
391	600633	浙报传媒	25,242	494,743.20	0.07
392	600433	冠豪高新	32,103	494,065.17	0.07
393	002063	远光软件	15,744	492,314.88	0.07
394	600478	科力远	28,908	492,014.16	0.07
395	000758	中色股份	25,038	491,495.94	0.07
396	000062	深圳华强	8,583	489,831.81	0.07
397	601699	潞安环能	50,607	489,369.69	0.07
398	600664	哈药股份	40,602	488,848.08	0.07
399	000066	长城电脑	29,014	488,595.76	0.07
400	601118	海南橡胶	49,948	488,491.44	0.07
401	300244	迪安诊断	5,800	486,852.00	0.07
402	300146	汤臣倍健	12,393	486,797.04	0.07
403	600151	航天机电	30,281	485,404.43	0.07
404	601958	金钼股份	41,052	483,592.56	0.07
405	000656	金科股份	69,971	483,499.61	0.07
406	600038	中直股份	7,675	475,466.25	0.07
407	000988	华工科技	26,491	471,804.71	0.07
408	000939	凯迪电力	32,018	469,063.70	0.06
409	002344	海宁皮城	23,864	468,450.32	0.06
410	000539	粤电力 A	43,320	468,289.20	0.06
411	002573	国电清新	22,628	467,720.76	0.06

412	000088	盐田港	32,889	465,708.24	0.06
413	002358	森源电气	21,676	465,600.48	0.06
414	600648	外高桥	13,261	465,195.88	0.06
415	002340	格林美	30,523	464,254.83	0.06
416	600549	厦门钨业	18,374	464,127.24	0.06
417	002195	海隆软件	11,150	463,394.00	0.06
418	300291	华录百纳	12,100	456,896.00	0.06
419	002368	太极股份	8,658	456,536.34	0.06
420	002271	东方雨虹	17,686	454,530.20	0.06
421	600138	中青旅	21,467	453,383.04	0.06
422	002269	美邦服饰	40,120	452,954.80	0.06
423	000933	神火股份	48,010	452,254.20	0.06
424	600805	悦达投资	28,935	452,254.05	0.06
425	000671	阳光城	21,693	450,780.54	0.06
426	600482	风帆股份	12,590	450,596.10	0.06
427	600835	上海机电	13,668	450,223.92	0.06
428	600270	外运发展	15,369	448,160.04	0.06
429	600064	南京高科	22,971	447,934.50	0.06
430	000652	泰达股份	43,726	445,130.68	0.06
431	000732	泰禾集团	12,976	443,779.20	0.06
432	300133	华策影视	16,391	442,557.00	0.06
433	600409	三友化工	39,099	441,818.70	0.06
434	000979	中弘股份	77,865	439,937.25	0.06
435	600120	浙江东方	12,948	438,807.72	0.06
436	600366	宁波韵升	14,269	438,200.99	0.06
437	600067	冠城大通	44,024	436,718.08	0.06
438	002106	莱宝高科	23,046	436,260.78	0.06
439	000650	仁和药业	32,472	434,800.08	0.06
440	601311	骆驼股份	18,642	434,545.02	0.06
441	600880	博瑞传播	27,855	432,588.15	0.06
442	000830	鲁西化工	43,384	432,104.64	0.06
443	600422	昆药集团	11,672	431,046.96	0.06
444	002665	首航节能	15,545	430,596.50	0.06
445	603766	隆鑫通用	17,135	430,088.50	0.06
446	600006	东风汽车	33,818	428,812.24	0.06
447	300274	阳光电源	14,000	427,980.00	0.06
448	002005	德豪润达	37,253	427,664.44	0.06
449	000543	皖能电力	23,091	427,645.32	0.06
450	000415	渤海租赁	44,986	425,567.56	0.06

451	002325	洪涛股份	17,822	425,411.14	0.06
452	002308	威创股份	18,300	423,645.00	0.06
453	002179	中航光电	12,821	423,093.00	0.06
454	600160	巨化股份	38,338	422,484.76	0.06
455	600580	卧龙电气	23,648	421,643.84	0.06
456	002092	中泰化学	41,275	420,592.25	0.06
457	600056	中国医药	17,262	420,157.08	0.06
458	600812	华北制药	34,586	419,874.04	0.06
459	000829	天音控股	28,164	418,235.40	0.06
460	600458	时代新材	16,600	416,660.00	0.06
461	600699	均胜电子	10,859	416,008.29	0.06
462	600161	天坛生物	11,038	415,691.08	0.06
463	600747	大连控股	52,404	415,563.72	0.06
464	600481	双良节能	17,322	414,861.90	0.06
465	600398	海澜之家	22,862	414,488.06	0.06
466	600557	康缘药业	14,856	413,442.48	0.06
467	002273	水晶光电	13,114	409,812.50	0.06
468	600673	东阳光科	41,353	408,981.17	0.06
469	002029	七匹狼	19,210	403,410.00	0.06
470	000697	炼石有色	11,698	399,486.70	0.06
471	600380	健康元	26,267	398,207.72	0.06
472	300115	长盈精密	11,933	397,488.23	0.06
473	000090	天健集团	16,377	397,142.25	0.05
474	002051	中工国际	13,304	396,193.12	0.05
475	002001	新和成	23,153	395,684.77	0.05
476	000528	柳工	33,439	395,248.98	0.05
477	600176	中国巨石	14,604	395,184.24	0.05
478	000028	国药一致	5,303	395,126.53	0.05
479	002428	云南锗业	16,804	395,062.04	0.05
480	002508	老板电器	10,287	394,609.32	0.05
481	000973	佛塑科技	32,722	392,664.00	0.05
482	000685	中山公用	13,273	390,624.39	0.05
483	002414	高德红外	9,921	390,093.72	0.05
484	002440	闰土股份	16,212	388,601.64	0.05
485	300134	大富科技	13,816	386,157.20	0.05
486	600267	海正药业	20,517	385,514.43	0.05
487	600289	亿阳信通	19,286	384,369.98	0.05
488	002294	信立泰	13,413	383,611.80	0.05
489	600284	浦东建设	23,520	383,611.20	0.05

490	601717	郑煤机	35,046	382,351.86	0.05
491	000587	金叶珠宝	16,523	382,176.99	0.05
492	002299	圣农发展	18,783	381,294.90	0.05
493	002390	信邦制药	21,257	380,075.16	0.05
494	300202	聚龙股份	9,396	379,598.40	0.05
495	601666	平煤股份	49,994	378,454.58	0.05
496	002190	成飞集成	7,400	377,326.00	0.05
497	000777	中核科技	11,434	375,606.90	0.05
498	600536	中国软件	10,584	375,520.32	0.05
499	002396	星网锐捷	11,623	373,098.30	0.05
500	000680	山推股份	42,000	372,540.00	0.05
501	000816	江淮动力	36,021	372,457.14	0.05
502	600062	华润双鹤	14,297	372,293.88	0.05
503	600216	浙江医药	27,809	369,303.52	0.05
504	000669	金鸿能源	8,846	369,143.58	0.05
505	600825	新华传媒	22,191	368,148.69	0.05
506	603288	海天味业	11,526	368,140.44	0.05
507	600183	生益科技	36,103	367,889.57	0.05
508	002595	豪迈科技	17,026	367,421.08	0.05
509	002437	誉衡药业	12,492	362,892.60	0.05
510	600300	维维股份	35,478	360,101.70	0.05
511	000937	冀中能源	44,887	359,993.74	0.05
512	600790	轻纺城	28,940	358,856.00	0.05
513	002155	辰州矿业	28,800	357,984.00	0.05
514	600757	长江传媒	25,692	357,118.80	0.05
515	600572	康恩贝	15,693	356,231.10	0.05
516	600546	山煤国际	41,746	355,258.46	0.05
517	600783	鲁信创投	9,478	355,235.44	0.05
518	000422	湖北宜化	38,132	351,958.36	0.05
519	002399	海普瑞	10,351	351,830.49	0.05
520	000735	罗牛山	37,362	350,829.18	0.05
521	000572	海马汽车	41,684	349,728.76	0.05
522	002168	深圳惠程	22,500	349,200.00	0.05
523	000848	承德露露	19,178	349,039.60	0.05
524	002311	海大集团	25,280	348,611.20	0.05
525	600884	杉杉股份	12,164	347,890.40	0.05
526	600826	兰生股份	8,976	346,742.88	0.05
527	600736	苏州高新	30,338	345,549.82	0.05
528	002244	滨江集团	18,682	343,935.62	0.05

529	600545	新疆城建	22,900	343,729.00	0.05
530	002477	雏鹰农牧	17,799	341,740.80	0.05
531	600614	鼎立股份	11,426	341,408.88	0.05
532	000926	福星股份	24,150	340,756.50	0.05
533	000488	晨鸣纸业	37,691	338,088.27	0.05
534	603019	中科曙光	3,900	337,701.00	0.05
535	002221	东华能源	11,310	337,377.30	0.05
536	002551	尚荣医疗	7,775	337,357.25	0.05
537	000541	佛山照明	29,195	334,866.65	0.05
538	300088	长信科技	12,155	334,262.50	0.05
539	002013	中航机电	11,876	330,746.60	0.05
540	600112	天成控股	17,407	330,733.00	0.05
541	600004	白云机场	19,565	330,648.50	0.05
542	300039	上海凯宝	21,176	329,286.80	0.05
543	000550	江铃汽车	8,963	328,942.10	0.05
544	601001	大同煤业	35,557	328,546.68	0.05
545	000620	新华联	24,115	328,446.30	0.05
546	600487	亨通光电	8,900	327,520.00	0.05
547	600260	凯乐科技	19,903	327,404.35	0.05
548	600628	新世界	19,455	325,871.25	0.05
549	601369	陕鼓动力	27,809	325,643.39	0.05
550	000021	深科技	21,321	325,145.25	0.05
551	600180	瑞茂通	11,334	324,832.44	0.04
552	000861	海印股份	15,073	323,918.77	0.04
553	002251	步步高	13,259	323,519.60	0.04
554	600509	天富能源	22,978	323,300.46	0.04
555	002064	华峰氨纶	35,622	323,091.54	0.04
556	002122	天马股份	30,124	320,820.60	0.04
557	000931	中关村	22,815	320,778.90	0.04
558	600259	广晟有色	5,464	320,518.24	0.04
559	600596	新安股份	22,978	320,313.32	0.04
560	601002	晋亿实业	20,233	320,086.06	0.04
561	002384	东山精密	14,476	320,064.36	0.04
562	000513	丽珠集团	4,718	320,021.94	0.04
563	002444	巨星科技	17,269	319,131.12	0.04
564	000099	中信海直	17,899	318,244.22	0.04
565	600351	亚宝药业	23,492	318,081.68	0.04
566	600851	海欣股份	25,058	317,234.28	0.04
567	000975	银泰资源	18,394	316,928.62	0.04

568	300043	互动娱乐	21,100	316,711.00	0.04
569	600993	马应龙	9,852	316,150.68	0.04
570	002309	中利科技	11,305	315,974.75	0.04
571	600059	古越龙山	20,570	315,132.40	0.04
572	600809	山西汾酒	11,153	314,960.72	0.04
573	002048	宁波华翔	15,098	313,887.42	0.04
574	002345	潮宏基	17,482	313,627.08	0.04
575	600998	九州通	14,008	313,218.88	0.04
576	000969	安泰科技	21,682	311,787.16	0.04
577	002317	众生药业	11,041	311,245.79	0.04
578	600859	王府井	9,772	307,818.00	0.04
579	601880	大连港	42,722	307,598.40	0.04
580	000900	现代投资	29,918	306,958.68	0.04
581	000877	天山股份	26,188	306,923.36	0.04
582	600761	安徽合力	18,333	306,711.09	0.04
583	000762	西藏矿业	16,088	305,672.00	0.04
584	002672	东江环保	14,445	305,511.75	0.04
585	600416	湘电股份	16,957	304,378.15	0.04
586	600395	盘江股份	23,286	303,882.30	0.04
587	002056	横店东磁	9,684	302,915.52	0.04
588	002727	一心堂	3,645	301,149.90	0.04
589	000401	冀东水泥	22,856	300,556.40	0.04
590	600702	沱牌舍得	11,492	300,056.12	0.04
591	600261	阳光照明	36,876	299,801.88	0.04
592	002642	荣之联	5,200	297,180.00	0.04
593	000961	中南建设	14,870	296,953.90	0.04
594	002463	沪电股份	35,555	296,884.25	0.04
595	000636	风华高科	23,736	296,225.28	0.04
596	002482	广田股份	10,800	294,840.00	0.04
597	600298	安琪酵母	8,467	294,482.26	0.04
598	002249	大洋电机	22,900	293,578.00	0.04
599	600894	广日股份	14,676	292,932.96	0.04
600	603077	和邦股份	14,076	292,780.80	0.04
601	002093	国脉科技	18,294	292,704.00	0.04
602	601886	江河创建	19,660	292,540.80	0.04
603	600823	世茂股份	22,445	292,458.35	0.04
604	600460	士兰微	31,661	292,231.03	0.04
605	000563	陕国投 A	20,660	290,686.20	0.04
606	002028	思源电气	15,781	290,370.40	0.04

607	600586	金晶科技	42,200	290,336.00	0.04
608	601139	深圳燃气	27,600	289,800.00	0.04
609	000869	张裕 A	5,927	289,178.33	0.04
610	600639	浦东金桥	11,896	288,953.84	0.04
611	002011	盾安环境	19,940	288,930.60	0.04
612	000850	华茂股份	23,333	288,862.54	0.04
613	002025	航天电器	11,018	288,671.60	0.04
614	600387	海越股份	12,536	288,578.72	0.04
615	002588	史丹利	9,984	287,040.00	0.04
616	002181	粤传媒	19,521	286,958.70	0.04
617	600748	上实发展	18,332	286,895.80	0.04
618	002422	科伦药业	7,161	286,726.44	0.04
619	002277	友阿股份	16,664	285,954.24	0.04
620	600885	宏发股份	9,058	283,877.72	0.04
621	000417	合肥百货	23,117	283,183.25	0.04
622	002373	千方科技	6,500	281,385.00	0.04
623	600496	精工钢构	38,435	280,959.85	0.04
624	600720	祁连山	26,367	279,226.53	0.04
625	600251	冠农股份	20,110	278,121.30	0.04
626	600485	信威集团	6,321	277,428.69	0.04
627	002237	恒邦股份	23,130	276,866.10	0.04
628	002371	七星电子	7,257	275,766.00	0.04
629	002408	齐翔腾达	15,804	270,880.56	0.04
630	600970	中材国际	18,262	266,990.44	0.04
631	600776	东方通信	16,161	266,494.89	0.04
632	600869	智慧能源	8,267	265,040.02	0.04
633	000726	鲁泰 A	19,020	264,378.00	0.04
634	002332	仙琚制药	15,232	263,818.24	0.04
635	601678	滨化股份	29,410	263,807.70	0.04
636	002431	棕榈园林	9,072	263,269.44	0.04
637	002663	普邦园林	27,100	262,870.00	0.04
638	000788	北大医药	14,289	262,774.71	0.04
639	601158	重庆水务	24,458	262,678.92	0.04
640	002233	塔牌集团	15,211	262,541.86	0.04
641	002041	登海种业	14,837	262,466.53	0.04
642	600640	号百控股	9,037	260,988.56	0.04
643	002203	海亮股份	21,942	259,354.44	0.04
644	600073	上海梅林	20,000	258,800.00	0.04
645	002078	太阳纸业	32,225	257,800.00	0.04

646	600831	广电网络	15,015	254,804.55	0.04
647	601777	力帆股份	16,055	253,508.45	0.04
648	000049	德赛电池	5,303	252,953.10	0.04
649	000919	金陵药业	12,900	251,292.00	0.03
650	002653	海思科	9,290	250,830.00	0.03
651	600039	四川路桥	38,391	250,693.23	0.03
652	002503	搜于特	13,274	250,613.12	0.03
653	002698	博实股份	4,745	250,536.00	0.03
654	600754	锦江股份	8,338	248,472.40	0.03
655	600337	美克家居	16,415	245,240.10	0.03
656	601233	桐昆股份	12,205	243,611.80	0.03
657	002254	泰和新材	15,073	242,675.30	0.03
658	600750	江中药业	7,417	238,753.23	0.03
659	600292	中电远达	7,758	236,929.32	0.03
660	600456	宝钛股份	9,080	236,715.60	0.03
661	600488	天药股份	24,405	236,484.45	0.03
662	600874	创业环保	18,453	235,275.75	0.03
663	002174	游族网络	2,511	232,920.36	0.03
664	600141	兴发集团	13,497	232,553.31	0.03
665	600132	重庆啤酒	10,326	232,541.52	0.03
666	601101	昊华能源	20,370	232,218.00	0.03
667	600199	金种子酒	16,549	231,686.00	0.03
668	002342	巨力索具	24,430	231,352.10	0.03
669	600636	三爱富	11,392	231,029.76	0.03
670	601908	京运通	10,996	230,696.08	0.03
671	600329	中新药业	9,158	230,690.02	0.03
672	000852	江钻股份	6,804	230,315.40	0.03
673	600425	青松建化	23,445	230,229.90	0.03
674	600335	国机汽车	8,312	229,577.44	0.03
675	000596	古井贡酒	4,908	229,105.44	0.03
676	002479	富春环保	12,464	228,714.40	0.03
677	600850	华东电脑	4,116	227,985.24	0.03
678	600997	开滦股份	26,216	225,981.92	0.03
679	600864	哈投股份	13,906	225,277.20	0.03
680	600188	兖州煤业	16,345	224,743.75	0.03
681	000418	小天鹅 A	9,392	224,468.80	0.03
682	000688	建新矿业	15,976	223,983.52	0.03
683	000600	建投能源	15,200	223,136.00	0.03
684	002128	露天煤业	13,506	222,578.88	0.03

685	002681	奋达科技	8,080	221,876.80	0.03
686	002480	新筑股份	13,639	221,770.14	0.03
687	600088	中视传媒	6,863	221,469.01	0.03
688	000501	鄂武商 A	10,800	221,400.00	0.03
689	601801	皖新传媒	7,554	220,350.18	0.03
690	002315	焦点科技	2,294	220,224.00	0.03
691	002204	大连重工	16,397	219,063.92	0.03
692	600773	西藏城投	12,324	217,025.64	0.03
693	002293	罗莱家纺	11,972	216,573.48	0.03
694	002646	青青稞酒	7,417	216,428.06	0.03
695	600729	重庆百货	6,725	216,410.50	0.03
696	000860	顺鑫农业	9,424	215,903.84	0.03
697	600429	三元股份	19,073	215,334.17	0.03
698	600657	信达地产	25,867	213,144.08	0.03
699	603188	亚邦股份	7,400	212,084.00	0.03
700	601126	四方股份	6,893	210,236.50	0.03
701	002140	东华科技	9,400	210,184.00	0.03
702	000426	兴业矿业	12,700	209,677.00	0.03
703	600510	黑牡丹	13,510	209,675.20	0.03
704	002461	珠江啤酒	8,105	208,055.35	0.03
705	002242	九阳股份	13,517	206,134.25	0.03
706	000951	中国重汽	7,120	205,198.40	0.03
707	002194	武汉凡谷	9,706	204,602.48	0.03
708	002069	獐子岛	11,385	204,246.90	0.03
709	600507	方大特钢	22,499	203,390.96	0.03
710	600566	济川药业	6,800	200,464.00	0.03
711	002216	三全食品	13,608	200,037.60	0.03
712	600280	中央商场	14,404	199,783.48	0.03
713	600392	盛和资源	7,792	198,773.92	0.03
714	603366	日出东方	13,508	198,567.60	0.03
715	600195	中牧股份	7,020	197,262.00	0.03
716	002275	桂林三金	7,717	197,246.52	0.03
717	000525	红太阳	8,767	196,117.79	0.03
718	002091	江苏国泰	8,653	194,173.32	0.03
719	600971	恒源煤电	21,183	193,824.45	0.03
720	601010	文峰股份	19,640	191,882.80	0.03
721	000519	江南红箭	9,675	191,661.75	0.03
722	600743	华远地产	23,825	191,314.75	0.03
723	601515	东风股份	9,418	190,243.60	0.03

724	600551	时代出版	8,746	189,875.66	0.03
725	600780	通宝能源	19,519	189,529.49	0.03
726	000703	恒逸石化	14,819	189,090.44	0.03
727	002574	明牌珠宝	10,417	187,193.49	0.03
728	000921	海信科龙	15,269	186,281.80	0.03
729	000030	富奥股份	16,097	186,242.29	0.03
730	000823	超声电子	13,668	183,971.28	0.03
731	002393	力生制药	3,979	181,760.72	0.03
732	600563	法拉电子	5,836	180,624.20	0.03
733	002327	富安娜	14,600	180,164.00	0.02
734	600537	亿晶光电	9,969	178,445.10	0.02
735	603001	奥康国际	5,703	178,047.66	0.02
736	600468	百利电气	7,554	176,083.74	0.02
737	002392	北京利尔	20,376	176,048.64	0.02
738	601225	陕西煤业	21,256	173,874.08	0.02
739	603555	贵人鸟	4,087	170,754.86	0.02
740	002281	光迅科技	3,494	167,991.52	0.02
741	000962	东方钨业	11,314	167,447.20	0.02
742	002678	珠江钢琴	8,171	165,707.88	0.02
743	600397	安源煤业	16,869	163,123.23	0.02
744	601969	海南矿业	8,900	162,247.00	0.02
745	000780	平庄能源	17,348	161,683.36	0.02
746	601226	华电重工	10,050	159,895.50	0.02
747	601231	环旭电子	9,300	158,193.00	0.02
748	002238	天威视讯	6,636	157,671.36	0.02
749	601965	中国汽研	12,095	157,355.95	0.02
750	600184	光电股份	5,454	153,584.64	0.02
751	002240	威华股份	11,278	152,929.68	0.02
752	000631	顺发恒业	18,603	150,498.27	0.02
753	601208	东材科技	13,176	150,469.92	0.02
754	603169	兰石重装	8,100	149,769.00	0.02
755	002635	安洁科技	5,998	146,051.30	0.02
756	002267	陕天然气	9,396	145,544.04	0.02
757	600803	新奥股份	8,488	145,229.68	0.02
758	002557	洽洽食品	8,767	143,603.46	0.02
759	002430	杭氧股份	10,742	142,009.24	0.02
760	603698	航天工程	3,600	141,912.00	0.02
761	600617	国新能源	7,700	140,679.00	0.02
762	603993	洛阳钼业	11,338	140,137.68	0.02

763	002225	濮耐股份	14,731	139,355.26	0.02
764	002648	卫星石化	9,088	137,592.32	0.02
765	600389	江山股份	4,294	134,144.56	0.02
766	601999	出版传媒	9,418	133,923.96	0.02
767	000552	靖远煤电	9,458	133,357.80	0.02
768	603005	晶方科技	2,669	130,540.79	0.02
769	600618	氯碱化工	9,554	129,743.32	0.02
770	603328	依顿电子	4,216	129,262.56	0.02
771	600403	大有能源	14,300	127,842.00	0.02
772	002662	京威股份	6,389	113,851.98	0.02
773	002419	天虹商场	6,666	113,322.00	0.02
774	000156	华数传媒	3,092	110,631.76	0.02
775	000603	盛达矿业	4,394	109,586.36	0.02
776	002490	山东墨龙	8,975	107,789.75	0.01
777	002143	印纪传媒	3,300	105,633.00	0.01
778	002466	天齐锂业	1,700	105,060.00	0.01
779	601005	重庆钢铁	16,500	93,885.00	0.01
780	603369	今世缘	2,489	92,317.01	0.01
781	600917	重庆燃气	7,300	92,272.00	0.01
782	603699	纽威股份	3,619	90,438.81	0.01
783	000582	北部湾港	4,200	89,334.00	0.01
784	600801	华新水泥	8,302	87,752.14	0.01
785	002705	新宝股份	3,819	71,797.20	0.01
786	000693	华泽钴镍	3,307	68,024.99	0.01

7.3.2 期末积极投资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	002354	天神娱乐	15,786	1,099,021.32	0.15
2	002429	兆驰股份	38,129	491,864.10	0.07
3	000959	首钢股份	74,405	460,566.95	0.06
4	000510	*ST 金路	34,906	318,691.78	0.04
5	002416	爱施德	12,922	271,232.78	0.04
6	002505	大康牧业	31,003	261,665.32	0.04
7	600333	长春燃气	10,555	121,065.85	0.02

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	7,344,281.00	1.02
2	600036	招商银行	4,575,912.00	0.63
3	600016	民生银行	3,919,563.00	0.54
4	300104	乐视网	3,405,607.85	0.47
5	601988	中国银行	3,397,282.00	0.47
6	600030	中信证券	3,289,821.00	0.46
7	601166	兴业银行	2,949,160.00	0.41
8	601901	方正证券	2,860,172.90	0.40
9	600837	海通证券	2,840,612.00	0.39
10	600000	浦发银行	2,723,241.26	0.38
11	000166	申万宏源	2,461,941.24	0.34
12	601106	中国一重	2,293,517.00	0.32
13	002230	科大讯飞	2,210,424.00	0.31
14	601398	工商银行	1,956,597.00	0.27
15	601919	中国远洋	1,897,519.66	0.26
16	600958	东方证券	1,892,180.50	0.26
17	002736	国信证券	1,865,075.00	0.26
18	000651	格力电器	1,716,674.00	0.24
19	600446	金证股份	1,705,067.00	0.24
20	000002	万科A	1,670,280.40	0.23

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	11,740,684.71	1.63
2	600036	招商银行	8,537,587.52	1.18
3	600016	民生银行	7,780,579.00	1.08
4	600030	中信证券	7,543,401.00	1.04
5	600837	海通证券	6,533,086.35	0.90
6	601166	兴业银行	6,326,483.62	0.88
7	600533	栖霞建设	5,889,410.00	0.82

8	000043	中航地产	5,704,714.93	0.79
9	000627	天茂集团	5,678,925.30	0.79
10	600000	浦发银行	4,814,980.00	0.67
11	601398	工商银行	4,454,486.00	0.62
12	601668	中国建筑	4,271,158.00	0.59
13	000002	万科A	4,163,113.18	0.58
14	002152	广电运通	4,122,574.32	0.57
15	000651	格力电器	4,003,192.00	0.55
16	601390	中国中铁	3,810,074.00	0.53
17	601989	中国重工	3,716,819.95	0.51
18	600887	伊利股份	3,543,906.18	0.49
19	000897	津滨发展	3,408,510.09	0.47
20	600761	安徽合力	3,301,019.52	0.46

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	143,078,464.51
卖出股票收入（成交）总额	319,422,171.61

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	91,545.30	0.01
8	其他	-	-
9	合计	91,545.30	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	630	91,545.30	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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。

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：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

1、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股中国平安。

根据 2014 年 12 月 8 日中国证券监督管理委员会发布对该公司控股子公司平安证券有限责任公司（以下简称“平安证券”）的《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》，决定对平安证券给予警告，没收保荐业务收入 400 万元，没收承销股票违法所得 2867 万元，并处以 440 万元罚款。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

2、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股中信证券。

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对中信证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本

基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

3、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股兴业银行。

根据 2015 年 6 月 9 日兴业银行公告“2015 年 5 月中旬，公司南宁分行下辖二级分行北海分行接到北海市公安局通报，该分行前员工苏瑜涉嫌个人非法集资已被立案，目前案件在调查阶段。公司南宁以及北海两级分行成立专项调查小组，就其涉及业务进行了全面内部排查，未发现银行资金卷入其中。目前，公司北海分行经营、财务状况与对外服务均正常。”本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

4、本基金跟踪复制标的指数中证 800 指数，配置了中证 800 指数成分股海通证券。

根据 2015 年 1 月 16 日中国证券监督管理委员会 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况的通报，对海通证券采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

除上述情况外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	220,137.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,107.95
5	应收申购款	50,198.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	281,443.66

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可转换债券。

7.12.5 期末资前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002354	天神娱乐	1,099,021.32	0.15	重大事项停牌
2	000959	首钢股份	460,566.95	0.06	重大事项停牌
3	000510	*ST 金路	318,691.78	0.04	重大事项停牌
4	002416	爱施德	271,232.78	0.04	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息 (转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
长盛同庆 800A	-	-	-	-	-	-
长盛同庆 800B	-	-	-	-	-	-
长盛同庆 中证 800 分级	13,018	41,655.28	323,713,066.87	59.70%	218,555,423.91	40.30%
合计	13,018	41,655.28	323,713,066.87	59.70%	218,555,423.91	40.30%

注：1、本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终，将同庆 800A 份额、同庆 800B 份额以各自的基金份额净值为基准转换为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金(LOF)份额。

2、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末上市基金前十名持有人

根据《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》的规定，同庆 800A 份额、同庆 800B

份额于 2015 年 5 月 21 日终止上市。本基金的基金管理人于 2015 年 5 月 21 日终，将同庆 800A 份额、同庆 800B 份额以各自的基金份额净值为基准转换为长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛同庆 800A	-	-
	长盛同庆 800B	-	-
	长盛同庆中证 800 分级	-	-
	合计	-	-

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛同庆 800A	0
	长盛同庆 800B	0
	长盛同庆中证 800 分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛同庆 800A	0
	长盛同庆 800B	0
	长盛同庆中证 800 分级	0
	合计	0

§ 8 基金份额持有人信息 (转型后)

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
12,166	36,142.05	255,377,112.87	58.08%	184,327,073.26	41.92%

8.2 期末上市基金前十名持有人

注：截止报告日 2015 年 6 月 30 日，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 未上市。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动 (转型前)

单位: 份

项目	长盛同庆 800A	长盛同庆 800B	长盛同庆中证 800 分级
基金合同生效日 (2012 年 5 月 12 日) 基金份额总额	-	-	14,686,733,239.06
本报告期期初基金份额总额	278,099,590.00	417,149,386.00	156,591,454.56
本报告期基金总申购份额	-	-	83,429,559.28
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	393,001,498.06
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-278,099,590.00	-417,149,386.00	695,248,975.00
本报告期期末基金份额总额	0.00	0.00	542,268,490.78

注: 拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换及基金折算变动份额。

§ 9 开放式基金份额变动 (转型后)

单位: 份

项目	长盛同庆中证 800 指数 (LOF)
基金合同生效日 (2015 年 5 月 22 日) 基金份额总额	542,268,490.78
本报告期期初基金份额总额	-
本报告期基金总申购份额	583,555.65
减:本报告期基金总赎回份额	103,147,860.30
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	439,704,186.13

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司第六届董事会第七次会议决议, 公司聘任林培富、王宁、蔡宾担任公司副总经理; 聘任孙杰、刁俊东为公司高管人员。以上三名副总经理于 2015 年 4 月 22 日通过中国证券投资基金业协会 (以下简称基金业协会) 组织的高级管理人员证券投资法律知识考试, 公司已及时向基金业协会进行备案。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知, 聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙), 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

基金管理人、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 (转型前)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	16,158,914.05	3.61	14,711.07	3.61	-
光大证券	1	33,511,914.97	7.49	30,509.30	7.49	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	61,266,989.57	13.69	55,777.60	13.69	-
东兴证券	1	150,180,227.96	33.56	136,722.81	33.56	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	63,799,352.68	14.26	58,083.28	14.26	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	122,636,808.40	27.40	111,647.53	27.40	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-

招商证券			-	-	-	-
东兴证券	340,000.00	78.01	-	-	-	-
华泰证券			-	-	-	-
海通证券			-	-	-	-
长江证券	63,349.00	14.53	-	-	-	-
国元证券			-	-	-	-
兴业证券			-	-	-	-
中金证券			-	-	-	-
银河证券	32,490.00	7.45	-	-	-	-
东方证券			-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	163,151,553.02	35.28%	148,486.02	35.27%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	81,024,882.35	17.52%	73,765.86	17.52%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	218,324,200.75	47.21%	198,762.56	47.21%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-

中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	783,450.90	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需，并能为本公司基金提供全面的信息服。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构

的服务不能满足要求, 或签约机构违规受到国家有关部门的处罚, 本公司有权终止签署的协议, 并撤销租用的交易单元;

(6) 交易单元租用协议期限为一年, 到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况: 无。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况: 无。

10.8 其他重大事件 (转型前)

除上述事项外, 均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下:

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之长盛同庆、同庆 800A、同庆 800B 暂停办理转托管业务的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2015-05-21
2	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期届满基金名称变更及转换基准日等事项的公告	同上	2015-05-21
3	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A、同庆 800B 基金份额终止上市提示性公告	同上	2015-05-20
4	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书摘要	同上	2015-05-18
5	长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书	同上	2015-05-18
6	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金暂停申购、赎回、转换、	同上	2015-05-18

	定期定额投资及转托管业务的公告		
7	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金之同庆 800A、同庆 800B 基金份额终止上市公告	同上	2015-05-18
8	长盛基金管理有限公司关于子公司法定代表人、执行董事及高管变更情况的公告	同上	2015-05-15
9	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额到期转换的提示性公告	同上	2015-05-14
10	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期届满与基金份额到期转换的公告	同上	2015-04-30
11	长盛基金管理有限公司关于新任副总经理的公告	同上	2015-04-24
12	关于旗下部分基金参加众禄基金费率优惠活动的公告	同上	2015-04-20
13	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期届满及份额转换的提示性公告	同上	2015-04-08
14	关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	同上	2015-03-16

10.8 其他重大事件 (转型后)

除上述事项外, 均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下:

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分开放式基金参加交	《中国证券报》《上海证券	2015-06-30

	通银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	报》《证券时报》及本公司网站	
2	关于旗下部分基金参加一路财富和同花顺费率优惠活动的公告	同上	2015-06-26
3	关于增加汇付金融和增财基金为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告	同上	2015-06-19
4	长盛基金管理有限公司关于增加联泰资产和钱景为旗下部分基金代销机构并推出定投业务及费率优惠活动的公告	同上	2015-06-19
5	关于我公司旗下部分开放式基金参加中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	同上	2015-06-01
6	关于旗下部分基金参加一路财富(北京)信息科技有限公司网上费率优惠活动的公告	同上	2015-05-28
7	关于在直销柜台开通旗下部分基金跨 TA 转换业务的公告	同上	2015-05-27
8	长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金分级运作期届满基金份额转换结果的公告	同上	2015-05-26

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金招募说明书》；

- 5、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- 6、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- 7、《长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- 8、法律意见书；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人互联网站免费查阅备查文件。
在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司
2015 年 8 月 27 日