

泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意，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 2017 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	80
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	81

8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	81
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	81
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	81
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
8.12	投资组合报告附注	81
§9	基金份额持有人信息	82
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	83
§10	开放式基金份额变动	83
§11	重大事件揭示	83
11.1	基金份额持有人大会决议	83
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	83
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4	基金投资策略的改变	84
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	84
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	84
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8	其他重大事件	85
§12	备查文件目录	86
12.1	备查文件目录	86
12.2	存放地点	86
12.3	查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金
基金简称	泰达宏利逆向策略混合
基金主代码	229002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 23 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
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	845,262,259.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过运用逆向投资策略，在有效控制投资组合风险的前提下，努力为投资者谋求资产的长期稳定增值。
投资策略	结合逆向投资核心理念和中国市场实际，本基金着重于资产配置策略和精选个股策略。在资产配置过程中，通过联邦模型寻找大类资产（股票或债券）被低估的时机，逆向投资于被低估的资产类别；在个股精选过程中，一方面利用估值和反转策略逆向精选个股，另一方面依据逆向投资理念把握事件冲击等不易量化的逆向投资机会，并辅以严格的优质公司特征分析及投资时机分析，力求获得逆向投资策略带来的长期超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈沛	田青
	联系电话	010-66577808	010-67595096
	电子邮箱	irm@mfteda.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-69-88888	010-67595096
传真		010-66577666	010-66275853

注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼 三层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼 三层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	弓劲梅	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	32,011,070.66	11,423,720.08	15,684,123.49
本期利润	974,643.16	12,800,982.29	12,059,089.04
加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.3353	0.6357
本期加权平均净值利润率	0.24%	15.42%	47.78%
本期基金份额净值增长率	10.13%	54.94%	34.79%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	665,090,397.70	38,286,548.90	28,035,778.79
期末可供分配基金份额利润	0.7868	0.9999	0.5384
期末基金资产净值	1,876,338,717.83	91,228,576.58	80,105,152.28
期末基金份额净值	2.220	2.383	1.538
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	162.44%	138.30%	53.80%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括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；

3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

3.2 基金净值表现

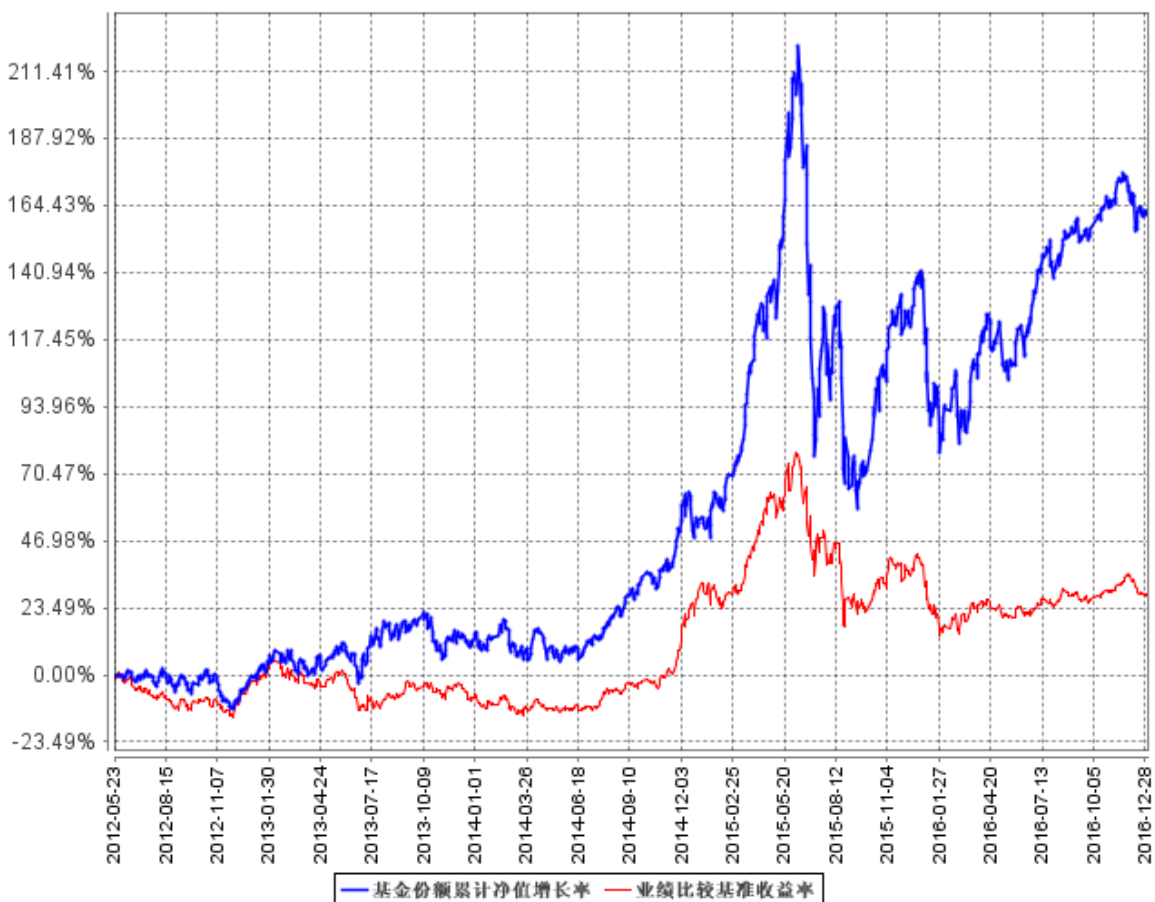
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.51%	0.91%	1.34%	0.54%	1.17%	0.37%
过去六个月	12.01%	0.92%	4.10%	0.57%	7.91%	0.35%
过去一年	10.13%	1.84%	-7.40%	1.05%	17.53%	0.79%
过去三年	130.00%	2.03%	37.65%	1.34%	92.35%	0.69%
自基金合同生效起至今	162.44%	1.82%	28.10%	1.23%	134.34%	0.59%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，指数样本选取沪深两个证券市场共 300 只股票，覆盖了大部分流通市值。成份股为市场代表性好，流动性高，交易活跃的主流投资股票，能够反映市场主流投资的收益情况，是沪深市场整体走势的最具代表性的跨市场指数，所以比较适合作为本基金权益类资产部分的比较基准。在本基金中，债券资产部分的投资主要是以降低投资组合整体风险为目的，所以在选择业绩比较基准过程中我们选择了成分券流动性较好，且风险较低的上证国债指数作为债券投资部分的业绩比较基准，该指数选取在上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的市场代表性。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

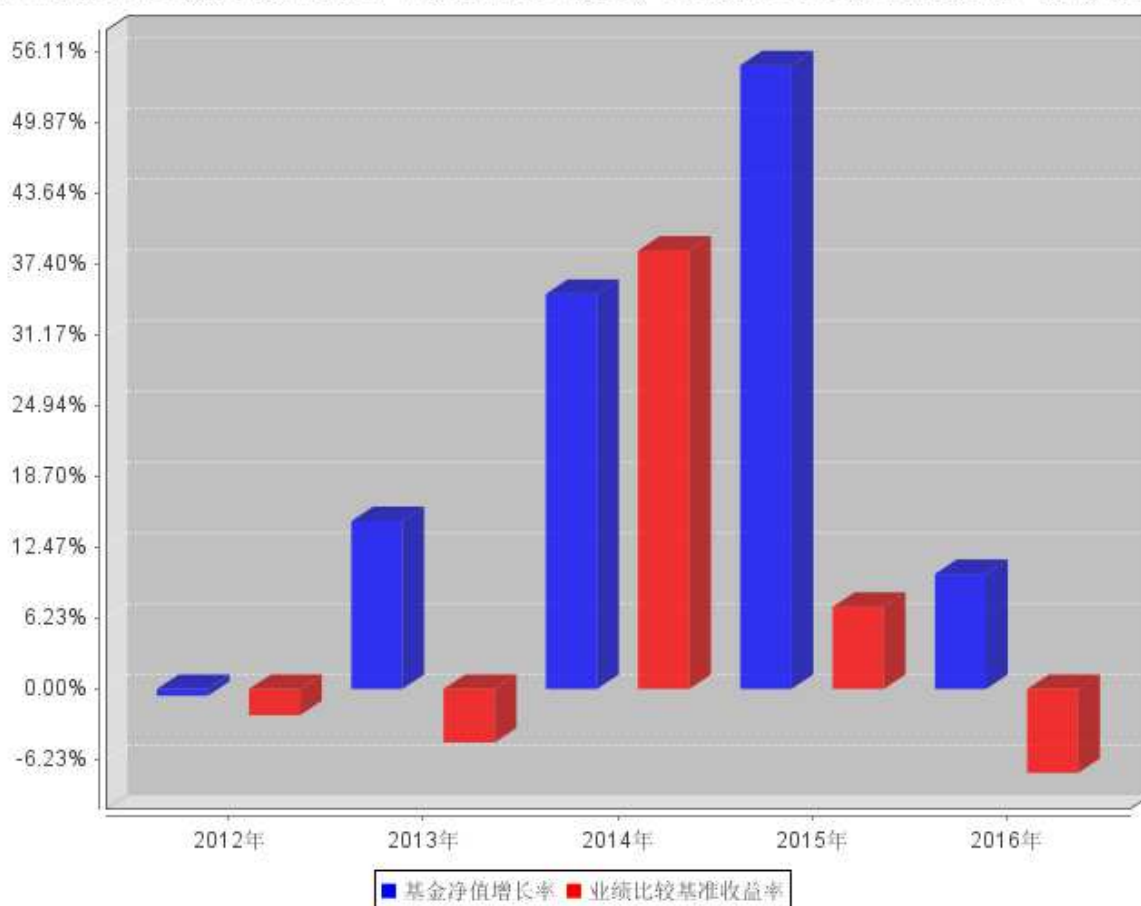
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓期末及报告期末已满足基金合同规定的投资比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2012 年 5 月 23 日，2012 年度净值增长率的计算期间为 2012 年 5 月 23 日至 2012 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2016	4.1000	84,881,548.79	33,725,256.64	118,606,805.43	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合 计	4.1000	84,881,548.79	33,725,256.64	118,606,805.43	

§ 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

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利收益增强债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金在内的四十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘欣	本基金基金经理； 金融工程部总经理	2014年1月3日	-	9	理学硕士，2007年7月至2008年12月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008年12月至2011年7月就职于嘉实基金管理有限公司；2011年7月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理，现担任金融工程部总经理；具备9年基金从业经验，9年证券投资管理经验，具有基金从业资格。

注：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。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）基金管理人管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，并经公司管理层审核签署后存档备查。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同窗口下的同向交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，未发现明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部对可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，定期对各投资组合的交易行为进行整体分析评估，定期向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。如发现疑似异常交易情况，相关投资组合经理对该交易情况进行合理性解释。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的情况共出现了 30 次。30 次涉及的投资组合一方均为按照量化策略进行投资，虽然买卖股票量少，但由于个股流动性较差，交易量少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年全年，A 股市场呈现震荡微跌格局。从板块层面看，低估值传统周期股受益于供给侧改革，具有一定涨幅；高分红绩优股票全年相对抗跌；高估值缺乏业绩支撑的前期热门股票跌幅较大。然而考虑到策略中小盘股票数目多，波动空间大，从全年看具有较强选股能力的部分中小盘基金业绩表现反而优于绩优大盘基金。这与主动组合投资基本规律相符，即投资结果取决于投资能力与投资空间两者，而非仅前者。

宏观层面，部分经济指标开始出现企稳迹象。上市公司整体平均盈利增速开始从低位抬升，部分周期性行业有较强的盈利恢复。但另一方面，资金面由前期的偏宽松转向中性，对股市和债市的支持作用有一定弱化。

本基金在操作中，有效的进行了结构性调整。投资风格兼顾成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司，和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 2.22 元，本报告期份额净值增长率为 10.13%，同期业绩比较基准增长率为-7.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济基本面筑底正在持续被部分宏观和分行业微观指标验证。而另一方面，潜在的通胀因素正在逐渐累积，央行对资金面开始有所控制。预计未来政策将在稳增长和控通胀之间。市场面来看，整体股票估值不低。一方面，受益于供给侧改革，钢铁、化工、煤炭等传统周期行业盈利大幅修复，带动估值的进一步修复，并开始向其他周期性行业蔓延；另一方面，蓝筹高分红股票的配置优势能否维系，取决于未来资金利率能否维持在较低的中枢位置；中小盘具有业绩基础的公司具有长期配置价值，而概念股票尽管在年初可能有短期炒作空间，但长期会被证伪。从情绪面看，市场波动率处于历史低点，整体向下风险有限。在此环境下，我们对市场的看法倾向于中幅震荡格局。在对市场结构把握较好的情况下，可能会取得相对理想可观的回报。未来如果控通胀、稳增长、调结构三者的关系得到较高的协调，从长远看，2018-2020 年可能会出现较大规模的牛市，而 2017 年是一个较好的投资起点。

基于此观点，我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的股票。在交易时机上，从逆向投资角度选取情绪相对低迷的时点参与，在情绪过度亢奋期退出。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部、风险管理部定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的基础库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司董事会及外部监管部门。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金于 2016 年 10 月 31 日公告按每 10 份基金份额派发 4.10 元进行利润分配，权益登记日、除权日为 2016 年 11 月 2 日，红利发放日为 2016 年 11 月 3 日，共分配 118,606,805.43 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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，本基金实施利润分配的金额为 118,606,805.43 元。

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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第 21853 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金(原泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金，以下简称“泰达宏利逆向策略混合基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰达宏利逆向策略混合基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基

	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财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。 我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为, 上述泰达宏利逆向策略混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国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, 公允反映了泰达宏利逆向策略混合基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	单峰 庞伊君
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2017 年 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金

报告截止日: 2016 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	124,616,601.50	6,411,466.95
结算备付金		23,377,979.27	814,615.29

存出保证金		442,222.70	112,377.39
交易性金融资产	7.4.7.2	1,712,863,966.97	84,481,627.64
其中：股票投资		1,712,863,966.97	84,481,627.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		68,247.58	-
应收利息	7.4.7.5	38,370.97	1,923.86
应收股利		-	-
应收申购款		26,758,409.87	113,115.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,888,165,798.86	91,935,126.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,611,970.31	142,920.34
应付管理人报酬		2,113,056.37	108,494.14
应付托管费		352,176.05	18,082.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,563,805.17	376,784.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	186,073.13	60,268.62
负债合计		11,827,081.03	706,550.33
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	845,262,259.49	38,290,067.32
未分配利润	7.4.7.10	1,031,076,458.34	52,938,509.26
所有者权益合计		1,876,338,717.83	91,228,576.58
负债和所有者权益总计		1,888,165,798.86	91,935,126.91

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.220 元，基金份额总额 845,262,259.49 份。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		24,374,278.49	17,209,922.24
1. 利息收入		339,062.21	76,201.35
其中：存款利息收入	7.4.7.11	339,062.21	76,201.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		54,488,045.16	15,309,207.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	52,160,664.73	13,652,773.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	2,016,960.00	1,242,060.00
股利收益	7.4.7.16	310,420.43	414,373.78
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-31,036,427.50	1,377,262.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	583,598.62	447,251.00
减：二、费用		23,399,635.33	4,408,939.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,739,505.24	1,227,260.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	956,584.15	204,543.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	16,482,307.42	2,755,930.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	221,238.52	221,205.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		974,643.16	12,800,982.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		974,643.16	12,800,982.29

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	38,290,067.32	52,938,509.26	91,228,576.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	974,643.16	974,643.16
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）	806,972,192.17	1,095,770,111.35	1,902,742,303.52
其中：1. 基金申购款	1,006,085,244.25	1,367,875,191.59	2,373,960,435.84
2. 基金赎回款	-199,113,052.08	-272,105,080.24	-471,218,132.32
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）	-	-118,606,805.43	-118,606,805.43
五、期末所有者权益（基金净值）	845,262,259.49	1,031,076,458.34	1,876,338,717.83
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	52,069,373.49	28,035,778.79	80,105,152.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	12,800,982.29	12,800,982.29
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）	-13,779,306.17	12,101,748.18	-1,677,557.99
其中：1. 基金申购款	144,971,752.20	215,411,374.28	360,383,126.48
2. 基金赎回款	-158,751,058.37	-203,309,626.10	-362,060,684.47
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）	38,290,067.32	52,938,509.26	91,228,576.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 刘建	_____ 傅国庆	_____ 王泉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金（原名为泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金，以下简称“本基金”）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[2011]第 1819 号《关于核准泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金募集的批复》核准，由泰达宏利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《泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 552,493,750.59 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 142 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 552,581,237.45 份基金份额，其中认购资金利息折合 87,486.86 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，泰达宏利逆向策略股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 30 日公告后更名为泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为：股票资产（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）占基金资产的 60%-95%，固定收益类资产占基金资产的 0%-35%，权证占基金资产净值的 0%-3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2017 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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(主要为股指期货投资)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外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外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,包括银行存款和其他各类应收款项等。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其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为股指期货投资)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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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，若出现重大事项停牌等情况，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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，暂免征收个人所得税。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	124,616,601.50	6,411,466.95

定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	124,616,601.50	6,411,466.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,742,041,399.25	1,712,863,966.97	-29,177,432.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,742,041,399.25	1,712,863,966.97	-29,177,432.28
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	82,622,632.42	84,481,627.64	1,858,995.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	82,622,632.42	84,481,627.64	1,858,995.22

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未进行买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	26,176.05	1,466.67
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	11,571.12	400.29
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	404.74	0.28
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	219.06	56.62
合计	38,370.97	1,923.86

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,563,805.17	376,784.88
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,563,805.17	376,784.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,073.13	268.62
预提费用	180,000.00	60,000.00
合计	186,073.13	60,268.62

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,290,067.32	38,290,067.32
本期申购	1,006,085,244.25	1,006,085,244.25
本期赎回（以“-”号填列）	-199,113,052.08	-199,113,052.08
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	845,262,259.49	845,262,259.49

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	38,286,548.90	14,651,960.36	52,938,509.26
本期利润	32,011,070.66	-31,036,427.50	974,643.16
本期基金份额交易产生的变动数	713,399,583.57	382,370,527.78	1,095,770,111.35
其中：基金申购款	895,303,224.25	472,571,967.34	1,367,875,191.59
基金赎回款	-181,903,640.68	-90,201,439.56	-272,105,080.24
本期已分配利润	-118,606,805.43	-	-118,606,805.43
本期末	665,090,397.70	365,986,060.64	1,031,076,458.34

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
	活期存款利息收入	243,699.18
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	66,887.08	12,150.75
其他	28,475.95	13,138.15
合计	339,062.21	76,201.35

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
卖出股票成交总额	4,882,582,997.61	908,342,424.38
减：卖出股票成本总额	4,830,422,332.88	894,689,650.48
买卖股票差价收入	52,160,664.73	13,652,773.90

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未有债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有贵金属投资申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	2,016,960.00	1,242,060.00
合计	2,016,960.00	1,242,060.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	310,420.43	414,373.78
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	310,420.43	414,373.78

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-31,036,427.50	1,377,262.21
——股票投资	-31,036,427.50	1,377,262.21
——债券投资	-	-
——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	-31,036,427.50	1,377,262.21
----	----------------	--------------

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	553,683.59	410,071.95
基金转换费收入	29,915.03	37,179.05
其他	-	-
合计	583,598.62	447,251.00

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 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，其中转出基金的不低于赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	16,482,307.42	2,755,930.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	16,482,307.42	2,755,930.44

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	130,000.00
银行费用	23,238.52	12,605.75
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	-	600.00
合计	221,238.52	221,205.75

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金截至 2016 年 12 月 31 日止的年度财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、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
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,739,505.24	1,227,260.41
其中：支付销售机构的客户维护费	2,117,399.39	388,889.98

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	956,584.15	204,543.35

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	124,616,601.50	243,699.18	6,411,466.95	50,912.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016年11月2日	-	2016年11月2日	4.1000	84,881,548.79	33,725,256.64	118,606,805.43	
合计	-	-	-	4.1000	84,881,548.79	33,725,256.64	118,606,805.43	

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	新股流通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	新股流通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	新股流通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	新股流通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-------	--------	--------	----

				价		价				
002165	红宝丽	2016年10月10日	重大事项	8.57	2017年1月5日	9.43	446,600	3,832,576.00	3,827,362.00	-
300480	光力科技	2016年10月10日	重大事项	22.22	2017年1月5日	24.44	155,400	3,443,737.57	3,452,988.00	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项	38.52	-	-	72,600	2,734,470.00	2,796,552.00	-
600552	凯盛科技	2016年9月8日	重大事项	18.43	2017年2月13日	17.51	147,400	2,538,194.00	2,716,582.00	-
600973	宝胜股份	2016年11月28日	重大事项	8.05	2017年2月22日	8.86	150,300	1,231,750.10	1,209,915.00	-
000560	昆百大A	2016年9月2日	重大事项	10.40	2017年3月24日	11.44	90,931	865,458.13	945,682.40	-
002034	美欣达	2016年10月10日	重大事项	36.33	2017年1月13日	39.96	18,100	618,825.90	657,573.00	-
002491	通鼎互联	2016年12月22日	重大事项	15.54	2017年1月3日	15.89	19,210	300,320.34	298,523.40	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只偏股混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具

相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。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。风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有债券(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 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证券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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	124,616,601.50	-	-	-	124,616,601.50
结算备付金	23,377,979.27	-	-	-	23,377,979.27
存出保证金	442,222.70	-	-	-	442,222.70
交易性金融资产	-	-	-	1,712,863,966.97	1,712,863,966.97
应收证券清算款	-	-	-	68,247.58	68,247.58
应收利息	-	-	-	38,370.97	38,370.97
应收申购款	197.63	-	-	26,758,212.24	26,758,409.87
资产总计	148,437,001.10	-	-	1,739,728,797.76	1,888,165,798.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,611,970.31	1,611,970.31
应付管理人报酬	-	-	-	2,113,056.37	2,113,056.37
应付托管费	-	-	-	352,176.05	352,176.05
应付交易费用	-	-	-	7,563,805.17	7,563,805.17
其他负债	-	-	-	186,073.13	186,073.13
负债总计	-	-	-	11,827,081.03	11,827,081.03
利率敏感度缺口	148,437,001.10	-	-	1,727,901,716.73	1,876,338,717.83
上年度末 2015 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	6,411,466.95	-	-	-	6,411,466.95
结算备付金	814,615.29	-	-	-	814,615.29
存出保证金	112,377.39	-	-	-	112,377.39
交易性金融资产	-	-	-	84,481,627.64	84,481,627.64
应收利息	-	-	-	1,923.86	1,923.86
应收申购款	-	-	-	113,115.78	113,115.78
资产总计	7,338,459.63	-	-	84,596,667.28	91,935,126.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	142,920.34	142,920.34
应付管理人报酬	-	-	-	108,494.14	108,494.14
应付托管费	-	-	-	18,082.35	18,082.35
应付交易费用	-	-	-	376,784.88	376,784.88
其他负债	-	-	-	60,268.62	60,268.62
负债总计	-	-	-	706,550.33	706,550.33
利率敏感度缺口	7,338,459.63	-	-	83,890,116.95	91,228,576.58

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早

者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有的交易性债券投资(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)占基金资产的 60%-95%，固定收益类资产占基金资产的 0%-35%，权证占基金资产净值的 0%-3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)

		(%)		
交易性金融资产-股票投资	1,712,863,966.97	91.29	84,481,627.64	92.60
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,712,863,966.97	91.29	84,481,627.64	92.60

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	110,230,000.00	4,150,000.00
	业绩比较基准下降 5%	-110,230,000.00	-4,150,000.00

7.4.14 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 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 1,696,583,243.45 元，属于第二层次的余额 16,280,723.52 元，无第三层次（2015 年 12 月 31 日：第一层次的余额为 78,988,495.36 元，第二层次的余额为 5,493,132.28，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和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易

不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金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和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,712,863,966.97	90.72
	其中:股票	1,712,863,966.97	90.72
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	147,994,580.77	7.84
7	其他各项资产	27,307,251.12	1.45
8	合计	1,888,165,798.86	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	36,832,648.03	1.96
B	采矿业	36,891,180.40	1.97
C	制造业	986,273,630.18	52.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,902,722.44	1.97
E	建筑业	17,129,629.17	0.91
F	批发和零售业	257,062,451.65	13.70
G	交通运输、仓储和邮政业	18,400,843.84	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,224,329.62	3.53
J	金融业	36,779,725.68	1.96
K	房地产业	184,088,548.56	9.81
L	租赁和商务服务业	18,395,856.00	0.98
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	17,882,401.40	0.95
	合计	1,712,863,966.97	91.29

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002126	银轮股份	2,011,513	19,491,560.97	1.04
2	000910	大亚圣象	1,007,765	19,248,311.50	1.03
3	603306	华懋科技	525,957	19,139,575.23	1.02
4	000521	美菱电器	2,761,103	19,106,832.76	1.02

5	000971	高升控股	804,497	19,026,354.05	1.01
6	300138	晨光生物	1,039,517	18,950,394.91	1.01
7	600586	金晶科技	4,086,701	18,921,425.63	1.01
8	603798	康普顿	296,300	18,918,755.00	1.01
9	002356	赫美集团	781,006	18,900,345.20	1.01
10	601992	金隅股份	4,227,389	18,854,154.94	1.00
11	600094	大名城	2,118,300	18,852,870.00	1.00
12	600208	新湖中宝	4,527,472	18,834,283.52	1.00
13	300121	阳谷华泰	1,031,900	18,811,537.00	1.00
14	002221	东华能源	1,517,801	18,805,554.39	1.00
15	600695	绿庭投资	1,954,701	18,765,129.60	1.00
16	000620	新华联	2,212,170	18,759,201.60	1.00
17	300306	远方光电	789,394	18,669,168.10	0.99
18	600861	北京城乡	1,201,800	18,615,882.00	0.99
19	600166	福田汽车	6,016,900	18,592,221.00	0.99
20	000030	富奥股份	2,186,030	18,581,255.00	0.99
21	000890	法尔胜	1,544,425	18,579,432.75	0.99
22	000671	阳光城	3,334,322	18,572,173.54	0.99
23	002234	民和股份	860,311	18,565,511.38	0.99
24	000889	茂业通信	1,215,147	18,555,294.69	0.99
25	000732	泰禾集团	1,047,159	18,524,242.71	0.99
26	601225	陕西煤业	3,816,524	18,510,141.40	0.99
27	603788	宁波高发	434,690	18,509,100.20	0.99
28	600461	洪城水业	2,430,483	18,495,975.63	0.99
29	603008	喜临门	1,008,795	18,460,948.50	0.98
30	603566	普莱柯	763,297	18,456,521.46	0.98
31	300092	科新机电	1,328,950	18,445,826.00	0.98
32	600127	金健米业	2,773,570	18,444,240.50	0.98
33	002457	青龙管业	1,586,900	18,423,909.00	0.98
34	603085	天成自控	365,900	18,412,088.00	0.98
35	002100	天康生物	2,052,444	18,410,422.68	0.98
36	600755	厦门国贸	2,244,500	18,404,900.00	0.98
37	000861	海印股份	3,792,960	18,395,856.00	0.98
38	000429	粤高速 A	2,688,799	18,391,385.16	0.98
39	002529	海源机械	869,641	18,384,210.74	0.98
40	600395	盘江股份	2,277,700	18,381,039.00	0.98
41	600223	鲁商置业	3,376,979	18,370,765.76	0.98
42	000421	南京公用	2,066,235	18,368,829.15	0.98
43	300354	东华测试	752,110	18,351,484.00	0.98

44	600605	汇通能源	776,101	18,339,266.63	0.98
45	600235	民丰特纸	1,727,927	18,333,305.47	0.98
46	002043	兔宝宝	1,584,250	18,329,772.50	0.98
47	002536	西泵股份	1,298,112	18,329,341.44	0.98
48	000877	天山股份	2,598,039	18,316,174.95	0.98
49	600387	海越股份	1,311,947	18,288,541.18	0.97
50	600736	苏州高新	2,025,208	18,287,628.24	0.97
51	002321	华英农业	1,705,615	18,267,136.65	0.97
52	002091	江苏国泰	1,375,434	18,238,254.84	0.97
53	300265	通光线缆	1,233,942	18,200,644.50	0.97
54	300119	瑞普生物	1,058,535	18,196,216.65	0.97
55	600128	弘业股份	1,193,272	18,149,667.12	0.97
56	600683	京投发展	2,050,163	18,143,942.55	0.97
57	002205	国统股份	594,747	18,127,888.56	0.97
58	600268	国电南自	2,008,768	18,119,087.36	0.97
59	002026	山东威达	1,567,501	18,104,636.55	0.96
60	000637	茂化实华	2,341,077	18,096,525.21	0.96
61	002425	凯撒文化	794,524	18,075,421.00	0.96
62	000789	万年青	2,247,251	18,045,425.53	0.96
63	600816	安信信托	762,684	18,014,596.08	0.96
64	000034	神州数码	807,022	18,012,731.04	0.96
65	002637	赞宇科技	1,277,700	17,951,685.00	0.96
66	300067	安诺其	2,081,339	17,899,515.40	0.95
67	600287	江苏舜天	1,674,069	17,895,797.61	0.95
68	000959	首钢股份	2,702,400	17,889,888.00	0.95
69	600624	复旦复华	2,079,349	17,882,401.40	0.95
70	600648	外高桥	904,400	17,852,856.00	0.95
71	002597	金禾实业	1,141,339	17,839,128.57	0.95
72	600847	万里股份	670,500	17,768,250.00	0.95
73	600882	广泽股份	1,653,906	17,762,950.44	0.95
74	000593	大通燃气	1,570,935	17,720,146.80	0.94
75	600602	云赛智联	1,859,236	17,718,519.08	0.94
76	000785	武汉中商	1,241,801	17,708,082.26	0.94
77	600510	黑牡丹	2,051,062	17,700,665.06	0.94
78	600778	友好集团	1,569,535	17,672,964.10	0.94
79	300259	新天科技	1,704,939	17,663,168.04	0.94
80	601965	中国汽研	1,656,180	17,638,317.00	0.94
81	300218	安利股份	1,086,499	17,623,013.78	0.94
82	002615	哈尔斯	998,571	17,524,921.05	0.93

83	002172	澳洋科技	1,708,235	17,475,244.05	0.93
84	002235	安妮股份	1,093,436	17,407,501.12	0.93
85	601233	桐昆股份	1,204,968	17,303,340.48	0.92
86	300108	双龙股份	1,869,308	17,291,099.00	0.92
87	002548	金新农	1,193,200	17,217,876.00	0.92
88	600051	宁波联合	1,317,352	17,217,790.64	0.92
89	002206	海利得	899,190	17,210,496.60	0.92
90	601636	旗滨集团	4,413,900	17,125,932.00	0.91
91	600853	龙建股份	2,469,558	17,114,036.94	0.91
92	000736	中房地产	875,300	17,024,585.00	0.91
93	002410	广联达	731,676	10,682,469.60	0.57
94	002165	红宝丽	446,600	3,827,362.00	0.20
95	300480	光力科技	155,400	3,452,988.00	0.18
96	300065	海兰信	72,600	2,796,552.00	0.15
97	600552	凯盛科技	147,400	2,716,582.00	0.14
98	600693	东百集团	240,622	2,435,094.64	0.13
99	300280	南通锻压	63,900	2,184,741.00	0.12
100	600973	宝胜股份	150,300	1,209,915.00	0.06
101	002016	世荣兆业	106,394	1,018,190.58	0.05
102	000560	昆百大A	90,931	945,682.40	0.05
103	300141	和顺电气	38,700	905,193.00	0.05
104	300161	华中数控	30,440	791,440.00	0.04
105	000096	广聚能源	51,300	759,240.00	0.04
106	603818	曲美家居	39,030	681,073.50	0.04
107	002034	美欣达	18,100	657,573.00	0.04
108	002491	通鼎互联	19,210	298,523.40	0.02
109	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
110	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
111	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
112	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
113	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
114	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
115	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
116	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
117	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
118	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
119	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
120	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
121	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00

122	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
123	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
124	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
125	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
126	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
127	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
128	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
129	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
130	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
131	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
132	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
133	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002493	荣盛石化	35,556,875.33	38.98
2	002356	赫美集团	33,799,887.20	37.05
3	601636	旗滨集团	33,122,364.80	36.31
4	603085	天成自控	31,692,566.23	34.74
5	300259	新天科技	30,949,738.79	33.93
6	002100	天康生物	30,886,639.17	33.86
7	002597	金禾实业	30,518,009.00	33.45
8	600287	江苏舜天	30,232,946.34	33.14
9	002247	帝龙文化	30,162,641.13	33.06
10	002087	新野纺织	28,374,571.73	31.10
11	603566	普莱柯	28,250,130.31	30.97
12	000030	富奥股份	28,200,975.73	30.91
13	600736	苏州高新	28,009,144.63	30.70
14	002548	金新农	27,505,566.63	30.15
15	002529	海源机械	27,476,358.41	30.12
16	300138	晨光生物	27,348,474.05	29.98
17	300036	超图软件	27,018,504.99	29.62
18	601233	桐昆股份	26,811,805.10	29.39

19	600395	盘江股份	26,647,603.05	29.21
20	600586	金晶科技	26,514,500.11	29.06
21	002235	安妮股份	26,470,891.94	29.02
22	603306	华懋科技	26,379,394.58	28.92
23	603868	飞科电器	26,179,277.38	28.70
24	601965	中国汽研	26,153,565.39	28.67
25	000732	泰禾集团	26,092,362.13	28.60
26	600051	宁波联合	25,935,254.74	28.43
27	000906	物产中拓	25,804,227.17	28.29
28	000620	新华联	25,276,602.81	27.71
29	002410	广联达	25,263,523.06	27.69
30	600816	安信信托	25,048,066.84	27.46
31	002234	民和股份	24,553,634.98	26.91
32	600624	复旦复华	24,385,818.56	26.73
33	300306	远方光电	24,364,491.02	26.71
34	600128	弘业股份	24,253,131.40	26.59
35	601992	金隅股份	24,213,295.70	26.54
36	002221	东华能源	23,911,026.92	26.21
37	600695	绿庭投资	23,874,225.75	26.17
38	300119	瑞普生物	23,856,493.10	26.15
39	600223	鲁商置业	23,667,201.82	25.94
40	002615	哈尔斯	23,551,543.46	25.82
41	300354	东华测试	23,433,139.47	25.69
42	600683	京投发展	23,360,605.26	25.61
43	000421	南京公用	23,312,887.15	25.55
44	002076	雪莱特	23,304,428.22	25.55
45	002088	鲁阳节能	23,244,234.80	25.48
46	600808	马钢股份	22,946,236.65	25.15
47	300116	坚瑞沃能	22,933,049.84	25.14
48	000971	高升控股	22,840,968.13	25.04
49	300121	阳谷华泰	22,794,969.72	24.99
50	600648	外高桥	22,758,286.47	24.95
51	600755	厦门国贸	22,569,236.00	24.74
52	603008	喜临门	22,511,426.45	24.68
53	601699	潞安环能	22,480,697.67	24.64
54	601225	陕西煤业	22,135,886.55	24.26

55	000789	万年青	22,129,746.28	24.26
56	002321	华英农业	22,073,293.49	24.20
57	000877	天山股份	21,918,938.35	24.03
58	000034	神州数码	21,857,826.80	23.96
59	000868	安凯客车	21,767,675.47	23.86
60	002705	新宝股份	21,575,276.68	23.65
61	000671	阳光城	21,570,058.57	23.64
62	002385	大北农	21,523,636.24	23.59
63	300280	南通锻压	21,511,498.94	23.58
64	002026	山东威达	21,500,716.15	23.57
65	600861	北京城乡	21,372,363.80	23.43
66	000890	法尔胜	21,289,290.26	23.34
67	600853	龙建股份	21,128,774.22	23.16
68	300241	瑞丰光电	21,097,108.78	23.13
69	002043	兔宝宝	20,910,603.19	22.92
70	000667	美好置业	20,901,020.47	22.91
71	600693	东百集团	20,875,381.57	22.88
72	600127	金健米业	20,872,820.31	22.88
73	300130	新国都	20,805,417.82	22.81
74	600510	黑牡丹	20,793,254.41	22.79
75	002299	圣农发展	20,730,937.79	22.72
76	600602	云赛智联	20,709,695.20	22.70
77	000521	美菱电器	20,665,695.79	22.65
78	600605	汇通能源	20,609,810.25	22.59
79	002714	牧原股份	20,492,104.52	22.46
80	600268	国电南自	20,376,530.21	22.34
81	600461	洪城水业	20,373,006.66	22.33
82	002091	江苏国泰	20,135,739.54	22.07
83	002136	安纳达	20,085,818.52	22.02
84	002187	广百股份	19,886,122.38	21.80
85	600213	亚星客车	19,874,001.61	21.78
86	000593	大通燃气	19,819,359.29	21.72
87	600882	广泽股份	19,780,276.49	21.68
88	002079	苏州固锝	19,754,892.00	21.65
89	002425	凯撒文化	19,741,922.95	21.64
90	300067	安诺其	19,730,346.98	21.63

91	600241	时代万恒	19,692,321.18	21.59
92	002016	世荣兆业	19,608,939.74	21.49
93	600387	海越股份	19,582,726.68	21.47
94	600094	大名城	19,554,969.45	21.44
95	000898	鞍钢股份	19,550,226.30	21.43
96	600260	凯乐科技	19,548,053.63	21.43
97	600778	友好集团	19,545,231.24	21.42
98	000889	茂业通信	19,544,345.14	21.42
99	300092	科新机电	19,533,043.32	21.41
100	600208	新潮中宝	19,425,589.08	21.29
101	002172	澳洋科技	19,371,253.53	21.23
102	600449	宁夏建材	19,339,372.44	21.20
103	600507	方大特钢	19,289,713.87	21.14
104	000429	粤高速A	19,164,165.81	21.01
105	600166	福田汽车	18,907,593.12	20.73
106	002066	瑞泰科技	18,874,336.74	20.69
107	000910	大亚圣象	18,800,463.47	20.61
108	002637	赞宇科技	18,700,536.48	20.50
109	002457	青龙管业	18,697,250.25	20.49
110	300218	安利股份	18,689,467.96	20.49
111	603788	宁波高发	18,644,818.18	20.44
112	600235	民丰特纸	18,637,441.57	20.43
113	000861	海印股份	18,616,153.14	20.41
114	002536	西泵股份	18,574,904.55	20.36
115	300265	通光线缆	18,569,116.59	20.35
116	603798	康普顿	18,484,540.36	20.26
117	600082	海泰发展	18,470,160.66	20.25
118	600258	首旅酒店	18,433,267.75	20.21
119	002452	长高集团	18,206,401.71	19.96
120	600371	万向德农	18,119,953.20	19.86
121	000959	首钢股份	18,080,444.03	19.82
122	300198	纳川股份	18,015,224.01	19.75
123	600847	万里股份	17,958,700.24	19.69
124	000637	茂化实华	17,803,468.15	19.52
125	002126	银轮股份	17,783,105.79	19.49
126	601012	隆基股份	17,769,528.02	19.48

127	000785	武汉中商	17,741,097.65	19.45
128	002205	国统股份	17,740,259.76	19.45
129	000900	现代投资	17,738,697.78	19.44
130	000736	中房地产	17,641,818.08	19.34
131	600097	开创国际	17,581,869.36	19.27
132	600720	祁连山	17,389,276.86	19.06
133	002244	滨江集团	17,351,249.02	19.02
134	300161	华中数控	17,280,772.31	18.94
135	000965	天保基建	17,153,373.47	18.80
136	600438	通威股份	17,106,829.10	18.75
137	601908	京运通	16,994,137.67	18.63
138	600298	安琪酵母	16,877,380.23	18.50
139	002311	海大集团	16,852,553.67	18.47
140	300084	海默科技	16,845,636.95	18.47
141	002477	雏鹰农牧	16,827,368.63	18.45
142	002270	华明装备	16,808,698.48	18.42
143	002206	海利得	16,622,267.32	18.22
144	002768	国恩股份	16,545,179.42	18.14
145	300108	双龙股份	16,533,285.26	18.12
146	002182	云海金属	16,310,802.64	17.88
147	002677	浙江美大	16,264,516.83	17.83
148	600771	广誉远	16,194,697.67	17.75
149	601588	北辰实业	15,958,715.65	17.49
150	600508	上海能源	15,941,741.23	17.47
151	000419	通程控股	15,889,703.63	17.42
152	300160	秀强股份	15,815,580.71	17.34
153	002596	海南瑞泽	15,762,073.66	17.28
154	002638	勤上光电	15,169,104.60	16.63
155	000926	福星股份	15,125,117.59	16.58
156	300201	海伦哲	15,069,591.76	16.52
157	000023	深天地A	15,046,401.79	16.49
158	300031	宝通科技	14,962,902.25	16.40
159	300316	晶盛机电	14,938,720.84	16.38
160	600028	中国石化	14,909,824.59	16.34
161	000059	华锦股份	14,904,740.57	16.34
162	300048	合康新能	14,758,118.80	16.18

163	000936	华西股份	14,677,891.42	16.09
164	600261	阳光照明	14,530,812.93	15.93
165	600684	珠江实业	14,395,990.20	15.78
166	000909	数源科技	14,352,800.78	15.73
167	000983	西山煤电	14,333,927.17	15.71
168	600010	包钢股份	14,321,277.98	15.70
169	002572	索菲亚	14,194,886.35	15.56
170	002218	拓日新能	14,084,347.20	15.44
171	000709	河钢股份	13,982,418.00	15.33
172	600157	永泰能源	13,959,764.70	15.30
173	300283	温州宏丰	13,884,724.35	15.22
174	300164	通源石油	13,848,369.47	15.18
175	002003	伟星股份	13,848,365.82	15.18
176	601677	明泰铝业	13,834,620.48	15.16
177	601666	平煤股份	13,766,561.37	15.09
178	002114	罗平锌电	13,565,533.00	14.87
179	300091	金通灵	13,560,388.08	14.86
180	002188	巴士在线	13,550,419.27	14.85
181	300509	新美星	13,323,069.53	14.60
182	000820	神雾节能	13,275,533.55	14.55
183	300322	硕贝德	13,225,743.98	14.50
184	002518	科士达	13,186,389.82	14.45
185	603609	禾丰牧业	13,141,359.96	14.40
186	300342	天银机电	13,017,865.81	14.27
187	002746	仙坛股份	12,985,207.14	14.23
188	002427	尤夫股份	12,839,930.58	14.07
189	000502	绿景控股	12,818,782.03	14.05
190	300341	麦迪电气	12,748,447.08	13.97
191	300376	易事特	12,718,869.60	13.94
192	300457	赢合科技	12,624,088.76	13.84
193	002607	亚夏汽车	12,590,681.64	13.80
194	300118	东方日升	12,359,929.84	13.55
195	002781	奇信股份	12,274,869.79	13.46
196	002295	精艺股份	12,185,552.81	13.36
197	002255	海陆重工	12,166,561.70	13.34
198	300182	捷成股份	12,064,693.24	13.22

199	601001	大同煤业	11,960,355.87	13.11
200	002511	中顺洁柔	11,922,021.35	13.07
201	603818	曲美家居	11,895,899.41	13.04
202	601155	新城控股	11,895,104.57	13.04
203	603979	金诚信	11,859,748.37	13.00
204	002128	露天煤业	11,764,287.70	12.90
205	300409	道氏技术	11,757,029.15	12.89
206	300274	阳光电源	11,575,294.60	12.69
207	002502	骅威文化	11,539,118.52	12.65
208	000825	太钢不锈	11,526,799.48	12.64
209	002508	老板电器	11,293,295.19	12.38
210	000046	泛海控股	11,252,080.21	12.33
211	300247	乐金健康	11,179,123.42	12.25
212	001979	招商蛇口	11,150,686.51	12.22
213	002394	联发股份	11,114,400.65	12.18
214	002458	益生股份	11,068,872.50	12.13
215	002084	海鸥卫浴	11,016,607.00	12.08
216	002193	山东如意	10,982,496.30	12.04
217	300476	胜宏科技	10,966,916.07	12.02
218	600839	四川长虹	10,951,661.99	12.00
219	300230	永利股份	10,883,057.83	11.93
220	600737	中粮屯河	10,842,923.00	11.89
221	002480	新筑股份	10,760,064.00	11.79
222	300307	慈星股份	10,739,526.46	11.77
223	002057	中钢天源	10,704,230.64	11.73
224	603616	韩建河山	10,678,489.92	11.71
225	300279	和晶科技	10,670,829.47	11.70
226	002285	世联行	10,561,840.98	11.58
227	603686	龙马环卫	10,556,165.98	11.57
228	000526	紫光学大	10,463,546.98	11.47
229	002279	久其软件	10,460,059.46	11.47
230	300370	安控科技	10,316,256.57	11.31
231	603026	石大胜华	10,189,736.53	11.17
232	002080	中材科技	10,080,136.04	11.05
233	600690	青岛海尔	9,988,245.00	10.95
234	300042	朗科科技	9,896,091.54	10.85

235	601717	郑煤机	9,705,163.00	10.64
236	300258	精锻科技	9,623,602.10	10.55
237	002771	真视通	9,618,482.50	10.54
238	600382	广东明珠	9,554,068.80	10.47
239	600022	山东钢铁	9,551,747.00	10.47
240	603088	宁波精达	9,492,007.24	10.40
241	300008	天海防务	9,394,238.61	10.30
242	002684	猛狮科技	9,360,005.00	10.26
243	000055	方大集团	9,345,654.99	10.24
244	600362	江西铜业	9,342,948.72	10.24
245	002296	辉煌科技	9,261,683.17	10.15
246	002380	科远股份	9,220,378.33	10.11
247	000572	海马汽车	9,179,803.04	10.06
248	002213	特 尔 佳	9,136,127.10	10.01
249	000627	天茂集团	9,106,130.28	9.98
250	002301	齐心集团	9,052,513.81	9.92
251	002171	楚江新材	9,048,003.07	9.92
252	600162	香江控股	8,987,045.64	9.85
253	002716	金贵银业	8,870,675.20	9.72
254	601886	江河集团	8,844,810.60	9.70
255	300063	天龙集团	8,769,215.00	9.61
256	000060	中金岭南	8,721,159.00	9.56
257	002200	云投生态	8,669,525.18	9.50
258	300177	中海达	8,666,070.67	9.50
259	600503	华丽家族	8,663,359.24	9.50
260	000938	紫光股份	8,598,378.00	9.43
261	002124	天邦股份	8,582,972.68	9.41
262	300112	万讯自控	8,573,313.71	9.40
263	002232	启明信息	8,567,608.52	9.39
264	002155	湖南黄金	8,545,369.50	9.37
265	002041	登海种业	8,507,003.11	9.32
266	002144	宏达高科	8,500,562.73	9.32
267	002604	龙力生物	8,451,378.42	9.26
268	300373	扬杰科技	8,353,815.96	9.16
269	002147	新光圆成	8,337,256.71	9.14
270	002760	凤形股份	8,314,426.54	9.11

271	300140	启源装备	8,300,824.24	9.10
272	002366	台海核电	8,284,151.41	9.08
273	002532	新界泵业	8,276,572.97	9.07
274	002543	万和电气	8,271,737.08	9.07
275	601388	怡球资源	8,201,272.30	8.99
276	603919	金徽酒	8,094,359.12	8.87
277	002035	华帝股份	8,064,122.16	8.84
278	600282	南钢股份	8,062,921.83	8.84
279	002149	西部材料	8,055,038.98	8.83
280	002750	龙津药业	8,030,668.59	8.80
281	002598	山东章鼓	7,968,892.82	8.74
282	603027	千禾味业	7,963,256.83	8.73
283	000096	广聚能源	7,954,315.98	8.72
284	002757	南兴装备	7,892,363.98	8.65
285	300475	聚隆科技	7,887,082.35	8.65
286	002107	沃华医药	7,885,126.66	8.64
287	600309	万华化学	7,826,071.35	8.58
288	002718	友邦吊顶	7,758,144.89	8.50
289	300448	浩云科技	7,610,073.57	8.34
290	601137	博威合金	7,564,743.24	8.29
291	600668	尖峰集团	7,552,159.46	8.28
292	603020	爱普股份	7,515,057.06	8.24
293	000876	新希望	7,460,489.58	8.18
294	600090	同济堂	7,443,608.78	8.16
295	300246	宝莱特	7,388,636.97	8.10
296	300200	高盟新材	7,375,569.99	8.08
297	002713	东易日盛	7,338,077.28	8.04
298	600981	汇鸿集团	7,326,083.58	8.03
299	603898	好莱客	7,322,236.82	8.03
300	600220	江苏阳光	7,225,405.72	7.92
301	002435	长江润发	7,222,436.83	7.92
302	002403	爱仕达	7,220,152.12	7.91
303	002308	威创股份	7,050,959.00	7.73
304	002083	孚日股份	7,009,026.00	7.68
305	300231	银信科技	6,989,086.58	7.66
306	600595	中孚实业	6,987,541.05	7.66

307	601567	三星医疗	6,949,355.29	7.62
308	002646	青青稞酒	6,898,032.49	7.56
309	300248	新开普	6,875,818.66	7.54
310	600626	申达股份	6,803,966.85	7.46
311	002463	沪电股份	6,778,032.10	7.43
312	002260	德奥通航	6,752,711.72	7.40
313	002290	禾盛新材	6,746,533.00	7.40
314	000036	华联控股	6,737,857.09	7.39
315	300214	日科化学	6,659,334.50	7.30
316	300141	和顺电气	6,641,192.40	7.28
317	600073	上海梅林	6,639,556.00	7.28
318	002545	东方铁塔	6,601,063.65	7.24
319	300192	科斯伍德	6,586,838.88	7.22
320	300209	天泽信息	6,583,128.92	7.22
321	600482	中国动力	6,577,378.59	7.21
322	000979	中弘股份	6,574,758.10	7.21
323	300387	富邦股份	6,454,882.06	7.08
324	000506	中润资源	6,394,948.22	7.01
325	603100	川仪股份	6,393,698.00	7.01
326	300287	飞利信	6,375,682.00	6.99
327	600743	华远地产	6,357,644.32	6.97
328	603030	全筑股份	6,285,172.79	6.89
329	600064	南京高科	6,283,282.85	6.89
330	601777	力帆股份	6,264,559.81	6.87
331	300304	云意电气	6,263,936.90	6.87
332	002401	中海科技	6,245,742.69	6.85
333	002441	众业达	6,245,677.35	6.85
334	603366	日出东方	6,243,846.26	6.84
335	002609	捷顺科技	6,242,164.00	6.84
336	002090	金智科技	6,182,506.20	6.78
337	300250	初灵信息	6,171,816.93	6.77
338	300097	智云股份	6,132,867.00	6.72
339	000663	永安林业	6,092,375.87	6.68
340	300260	新莱应材	6,090,958.38	6.68
341	002372	伟星新材	6,089,238.44	6.67
342	300018	中元股份	6,066,179.44	6.65

343	002302	西部建设	6,051,927.38	6.63
344	600805	悦达投资	6,026,389.34	6.61
345	600327	大东方	6,003,807.60	6.58
346	300375	鹏翎股份	6,003,762.78	6.58
347	600325	华发股份	5,987,990.86	6.56
348	000816	智慧农业	5,918,969.56	6.49
349	002259	升达林业	5,918,157.50	6.49
350	600973	宝胜股份	5,887,360.91	6.45
351	002177	御银股份	5,869,169.00	6.43
352	300194	福安药业	5,862,897.47	6.43
353	002662	京威股份	5,834,263.00	6.40
354	300170	汉得信息	5,826,157.31	6.39
355	002367	康力电梯	5,814,471.82	6.37
356	300360	炬华科技	5,778,768.10	6.33
357	300023	宝德股份	5,729,011.07	6.28
358	600748	上实发展	5,708,553.63	6.26
359	000426	兴业矿业	5,702,985.58	6.25
360	002323	雅百特	5,693,832.35	6.24
361	002583	海能达	5,682,336.15	6.23
362	300158	振东制药	5,625,384.00	6.17
363	601238	广汽集团	5,544,913.00	6.08
364	002438	江苏神通	5,537,104.18	6.07
365	002418	康盛股份	5,461,640.15	5.99
366	600770	综艺股份	5,459,972.98	5.98
367	600409	三友化工	5,458,159.00	5.98
368	300305	裕兴股份	5,419,813.88	5.94
369	601100	恒立液压	5,414,482.40	5.94
370	002300	太阳电缆	5,387,220.97	5.91
371	600657	信达地产	5,357,245.46	5.87
372	600354	敦煌种业	5,342,590.51	5.86
373	300416	苏试试验	5,282,883.94	5.79
374	002726	龙大肉食	5,245,687.95	5.75
375	002623	亚玛顿	5,224,939.94	5.73
376	002226	江南化工	5,149,117.66	5.64
377	000514	渝开发	5,138,623.00	5.63
378	002309	中利科技	5,130,746.25	5.62

379	300074	华平股份	5,104,563.00	5.60
380	600702	沱牌舍得	5,104,031.92	5.59
381	300286	安科瑞	5,096,989.88	5.59
382	300196	长海股份	5,092,421.00	5.58
383	300452	山河药辅	5,085,600.60	5.57
384	300129	泰胜风能	5,083,514.00	5.57
385	300270	中威电子	5,064,561.14	5.55
386	002305	南国置业	5,030,046.04	5.51
387	300065	海兰信	5,028,357.93	5.51
388	000425	徐工机械	5,008,192.00	5.49
389	603355	莱克电气	5,003,215.20	5.48
390	300213	佳讯飞鸿	4,998,934.30	5.48
391	002553	南方轴承	4,993,531.95	5.47
392	603377	东方时尚	4,992,896.00	5.47
393	600159	大龙地产	4,946,079.50	5.42
394	603869	北部湾旅	4,879,669.34	5.35
395	002487	大金重工	4,869,250.31	5.34
396	002743	富煌钢构	4,792,464.73	5.25
397	300272	开能环保	4,775,601.52	5.23
398	300093	金刚玻璃	4,761,359.00	5.22
399	601898	中煤能源	4,737,489.66	5.19
400	000609	绵石投资	4,716,573.50	5.17
401	600284	浦东建设	4,694,250.60	5.15
402	600433	冠豪高新	4,637,297.99	5.08
403	000551	创元科技	4,634,773.83	5.08
404	600348	阳泉煤业	4,629,196.24	5.07
405	002523	天桥起重	4,619,287.81	5.06
406	300253	卫宁健康	4,601,609.23	5.04
407	000151	中成股份	4,601,153.23	5.04
408	002150	通润装备	4,597,464.45	5.04
409	002765	蓝黛传动	4,587,888.04	5.03
410	600638	新黄浦	4,572,427.74	5.01
411	000937	冀中能源	4,565,544.34	5.00
412	000698	沈阳化工	4,562,419.27	5.00
413	000587	金洲慈航	4,547,895.38	4.99
414	000969	安泰科技	4,475,642.17	4.91

415	002216	三全食品	4,422,791.86	4.85
416	002578	闽发铝业	4,409,088.13	4.83
417	300394	天孚通信	4,398,764.20	4.82
418	000032	深桑达A	4,369,867.84	4.79
419	603003	龙宇燃油	4,362,957.94	4.78
420	600060	海信电器	4,312,067.00	4.73
421	600823	世茂股份	4,304,895.02	4.72
422	601616	广电电气	4,301,963.00	4.72
423	600231	凌钢股份	4,293,934.00	4.71
424	600971	恒源煤电	4,293,049.95	4.71
425	300211	亿通科技	4,266,109.87	4.68
426	603789	星光农机	4,261,482.77	4.67
427	300064	豫金刚石	4,254,237.80	4.66
428	600889	南京化纤	4,250,979.00	4.66
429	002729	好利来	4,250,850.70	4.66
430	300021	大禹节水	4,241,726.20	4.65
431	600537	亿晶光电	4,238,801.00	4.65
432	002123	梦网荣信	4,226,671.85	4.63
433	000070	特发信息	4,224,458.40	4.63
434	600322	天房发展	4,215,916.58	4.62
435	600123	兰花科创	4,207,356.55	4.61
436	600359	新农开发	4,190,715.80	4.59
437	600615	丰华股份	4,185,523.06	4.59
438	300136	信维通信	4,171,125.00	4.57
439	300022	吉峰农机	4,148,861.95	4.55
440	603017	中衡设计	4,133,194.56	4.53
441	000541	佛山照明	4,132,554.61	4.53
442	002238	天威视讯	4,123,875.00	4.52
443	600846	同济科技	4,103,632.00	4.50
444	600240	华业资本	4,097,414.86	4.49
445	601339	百隆东方	4,087,169.00	4.48
446	300343	联创互联	4,071,012.00	4.46
447	300498	温氏股份	4,068,609.11	4.46
448	002554	惠博普	4,065,891.00	4.46
449	603688	石英股份	4,047,250.86	4.44
450	600651	飞乐音响	4,040,157.74	4.43

451	002756	永兴特钢	4,040,030.20	4.43
452	600337	美克家居	3,952,559.93	4.33
453	300480	光力科技	3,944,564.27	4.32
454	600612	老凤祥	3,944,168.33	4.32
455	002151	北斗星通	3,923,341.49	4.30
456	600531	豫光金铅	3,914,649.00	4.29
457	600336	澳柯玛	3,909,786.00	4.29
458	300029	天龙光电	3,901,591.00	4.28
459	000795	英洛华	3,886,543.00	4.26
460	600103	青山纸业	3,870,791.00	4.24
461	002165	红宝丽	3,832,576.00	4.20
462	000735	罗牛山	3,816,896.00	4.18
463	600148	长春一东	3,807,507.60	4.17
464	300269	联建光电	3,807,331.75	4.17
465	000821	京山轻机	3,805,506.62	4.17
466	000680	山推股份	3,805,243.95	4.17
467	600133	东湖高新	3,789,911.33	4.15
468	300389	艾比森	3,778,726.67	4.14
469	002600	江粉磁材	3,766,051.61	4.13
470	600093	禾嘉股份	3,749,657.16	4.11
471	600185	格力地产	3,743,004.60	4.10
472	600299	安迪苏	3,726,124.82	4.08
473	002093	国脉科技	3,725,208.08	4.08
474	600723	首商股份	3,707,900.39	4.06
475	000878	云南铜业	3,685,354.91	4.04
476	603311	金海环境	3,680,346.10	4.03
477	002503	搜于特	3,674,611.38	4.03
478	002062	宏润建设	3,656,673.07	4.01
479	002446	盛路通信	3,637,443.77	3.99
480	002388	新亚制程	3,633,875.00	3.98
481	002225	濮耐股份	3,620,606.00	3.97
482	600188	兖州煤业	3,600,440.00	3.95
483	002334	英威腾	3,575,125.36	3.92
484	600291	西水股份	3,568,391.00	3.91
485	300483	沃施股份	3,554,188.73	3.90
486	300329	海伦钢琴	3,543,570.50	3.88

487	600815	厦工股份	3,530,784.79	3.87
488	002167	东方锆业	3,524,312.50	3.86
489	002039	黔源电力	3,490,370.00	3.83
490	002707	众信旅游	3,488,613.00	3.82
491	002613	北玻股份	3,481,688.90	3.82
492	300151	昌红科技	3,471,869.00	3.81
493	600730	中国高科	3,469,675.00	3.80
494	002666	德联集团	3,417,046.56	3.75
495	000422	湖北宜化	3,390,376.01	3.72
496	600448	华纺股份	3,364,020.92	3.69
497	603099	长白山	3,333,418.72	3.65
498	600757	长江传媒	3,331,064.04	3.65
499	000807	云铝股份	3,328,922.00	3.65
500	000056	皇庭国际	3,324,603.01	3.64
501	000404	华意压缩	3,310,742.07	3.63
502	300444	双杰电气	3,279,378.55	3.59
503	300183	东软载波	3,277,585.22	3.59
504	000066	长城电脑	3,268,799.78	3.58
505	600525	长园集团	3,264,354.76	3.58
506	002674	兴业科技	3,257,894.04	3.57
507	601208	东材科技	3,250,489.00	3.56
508	600201	生物股份	3,244,054.92	3.56
509	002078	太阳纸业	3,241,444.00	3.55
510	002671	龙泉股份	3,228,051.36	3.54
511	600138	中青旅	3,218,185.94	3.53
512	600167	联美控股	3,204,682.00	3.51
513	600308	华泰股份	3,196,541.80	3.50
514	600373	中文传媒	3,193,397.45	3.50
515	002670	国盛金控	3,183,665.00	3.49
516	600552	凯盛科技	3,180,557.00	3.49
517	603969	银龙股份	3,176,838.57	3.48
518	002006	精功科技	3,084,547.71	3.38
519	600599	熊猫金控	3,059,275.30	3.35
520	600784	鲁银投资	3,050,977.00	3.34
521	600881	亚泰集团	3,044,033.00	3.34
522	002628	成都路桥	3,038,114.00	3.33

523	600067	冠城大通	3,031,561.79	3.32
524	002575	群兴玩具	3,014,677.44	3.30
525	600059	古越龙山	3,002,507.79	3.29
526	603988	中电电机	3,000,667.00	3.29
527	002282	博深工具	2,999,113.60	3.29
528	300471	厚普股份	2,996,067.83	3.28
529	002176	江特电机	2,981,918.73	3.27
530	002382	蓝帆医疗	2,980,519.72	3.27
531	300234	开尔新材	2,970,385.55	3.26
532	000882	华联股份	2,967,930.99	3.25
533	000701	厦门信达	2,963,173.54	3.25
534	600630	龙头股份	2,961,721.90	3.25
535	600425	青松建化	2,961,712.00	3.25
536	000682	东方电子	2,950,648.00	3.23
537	600801	华新水泥	2,927,166.70	3.21
538	600975	新五丰	2,926,189.00	3.21
539	600665	天地源	2,925,891.50	3.21
540	603006	黎明股份	2,924,640.06	3.21
541	300069	金利华电	2,911,678.99	3.19
542	300145	中金环境	2,906,467.66	3.19
543	600416	湘电股份	2,903,394.58	3.18
544	002051	中工国际	2,888,737.79	3.17
545	601098	中南传媒	2,808,859.86	3.08
546	300271	华宇软件	2,792,105.71	3.06
547	002560	通达股份	2,770,442.00	3.04
548	002220	天宝股份	2,758,843.62	3.02
549	600658	电子城	2,752,234.38	3.02
550	600477	杭萧钢构	2,714,284.20	2.98
551	002491	通鼎互联	2,695,378.99	2.95
552	600280	中央商场	2,688,665.82	2.95
553	300301	长方集团	2,626,186.24	2.88
554	300107	建新股份	2,592,188.56	2.84
555	300144	宋城演艺	2,574,009.43	2.82
556	600782	新钢股份	2,546,194.00	2.79
557	600313	农发种业	2,521,497.00	2.76
558	600398	海澜之家	2,519,389.00	2.76

559	600222	太龙药业	2,512,090.77	2.75
560	000418	小天鹅A	2,510,251.52	2.75
561	300311	任子行	2,489,573.65	2.73
562	600370	三房巷	2,485,889.00	2.72
563	600192	长城电工	2,471,015.29	2.71
564	600070	浙江富润	2,462,791.87	2.70
565	600850	华东电脑	2,440,276.00	2.67
566	300378	鼎捷软件	2,408,091.85	2.64
567	002641	永高股份	2,404,397.00	2.64
568	600802	福建水泥	2,400,761.90	2.63
569	600888	新疆众和	2,388,600.18	2.62
570	603025	大豪科技	2,379,027.77	2.61
571	002538	司尔特	2,377,029.00	2.61
572	600353	旭光股份	2,360,340.89	2.59
573	600361	华联综超	2,358,985.12	2.59
574	000888	峨眉山A	2,327,850.02	2.55
575	300089	文化长城	2,325,948.00	2.55
576	300143	星河生物	2,322,330.00	2.55
577	002648	卫星石化	2,319,936.77	2.54
578	000726	鲁泰A	2,308,466.00	2.53
579	300303	聚飞光电	2,279,476.48	2.50
580	600248	延长化建	2,266,341.48	2.48
581	603338	浙江鼎力	2,232,269.96	2.45
582	600523	贵航股份	2,225,296.35	2.44
583	000546	金圆股份	2,221,774.00	2.44
584	600742	一汽富维	2,195,028.00	2.41
585	002476	宝莫股份	2,170,222.99	2.38
586	600810	神马股份	2,155,901.59	2.36
587	300333	兆日科技	2,119,812.00	2.32
588	300478	杭州高新	2,119,619.00	2.32
589	600467	好当家	2,119,134.00	2.32
590	600191	华资实业	2,104,425.30	2.31
591	002027	分众传媒	2,083,016.41	2.28
592	601007	金陵饭店	2,070,402.92	2.27
593	600983	惠而浦	2,069,333.64	2.27
594	002581	未名医药	2,060,059.50	2.26

595	002510	天汽模	2,045,154.00	2.24
596	000778	新兴铸管	2,027,610.00	2.22
597	300175	朗源股份	2,024,221.55	2.22
598	600126	杭钢股份	2,006,611.00	2.20
599	002451	摩恩电气	1,996,862.16	2.19
600	600058	五矿发展	1,996,050.00	2.19
601	002606	大连电瓷	1,989,836.00	2.18
602	000603	盛达矿业	1,981,693.18	2.17
603	600290	华仪电气	1,980,341.63	2.17
604	000567	海德股份	1,980,093.74	2.17
605	300255	常山药业	1,956,120.60	2.14
606	002157	正邦科技	1,940,507.48	2.13
607	000903	云内动力	1,930,511.84	2.12
608	000619	海螺型材	1,920,415.51	2.11
609	002042	华孚色纺	1,916,542.50	2.10
610	300367	东方网力	1,912,663.82	2.10
611	002731	萃华珠宝	1,903,923.33	2.09
612	600077	宋都股份	1,894,071.00	2.08
613	300302	同有科技	1,893,683.20	2.08
614	000656	金科股份	1,874,240.00	2.05
615	002262	恩华药业	1,859,437.82	2.04
616	002333	罗普斯金	1,851,426.00	2.03
617	000919	金陵药业	1,846,569.92	2.02
618	002772	众兴菌业	1,838,486.55	2.02
619	002561	徐家汇	1,836,825.26	2.01
620	000488	晨鸣纸业	1,836,612.00	2.01
621	300157	恒泰艾普	1,831,911.00	2.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002493	荣盛石化	36,729,447.96	40.26
2	002247	帝龙文化	30,145,731.98	33.04

3	002087	新野纺织	29,305,604.63	32.12
4	603868	飞科电器	25,785,765.54	28.27
5	000906	物产中拓	25,594,217.37	28.06
6	300036	超图软件	24,866,339.52	27.26
7	601699	潞安环能	24,086,438.26	26.40
8	002088	鲁阳节能	23,165,162.65	25.39
9	600808	马钢股份	23,035,069.61	25.25
10	300116	坚瑞沃能	22,264,575.64	24.41
11	002076	雪莱特	22,173,680.37	24.31
12	600449	宁夏建材	21,854,044.17	23.96
13	002136	安纳达	21,435,139.68	23.50
14	002385	大北农	21,279,464.18	23.33
15	002705	新宝股份	21,037,552.20	23.06
16	600507	方大特钢	21,008,030.35	23.03
17	000868	安凯客车	20,833,318.00	22.84
18	002714	牧原股份	20,541,117.55	22.52
19	000667	美好置业	20,518,683.31	22.49
20	600260	凯乐科技	20,506,452.29	22.48
21	000898	鞍钢股份	20,475,203.72	22.44
22	300130	新国都	20,470,803.95	22.44
23	002187	广百股份	19,974,453.67	21.89
24	002066	瑞泰科技	19,912,485.47	21.83
25	002079	苏州固锴	19,796,887.98	21.70
26	600082	海泰发展	19,641,698.27	21.53
27	300280	南通锻压	19,437,364.45	21.31
28	300241	瑞丰光电	19,396,354.51	21.26
29	600213	亚星客车	19,244,117.63	21.09
30	600097	开创国际	19,138,851.78	20.98
31	002299	圣农发展	18,667,935.14	20.46
32	600371	万向德农	18,543,122.68	20.33
33	300376	易事特	18,249,083.80	20.00
34	600693	东百集团	18,200,482.96	19.95
35	600438	通威股份	18,015,212.85	19.75
36	002016	世荣兆业	17,923,015.45	19.65
37	300198	纳川股份	17,910,966.00	19.63
38	002452	长高集团	17,868,637.71	19.59
39	600241	时代万恒	17,866,488.78	19.58
40	300084	海默科技	17,780,052.76	19.49

41	600720	祁连山	17,698,688.58	19.40
42	601012	隆基股份	17,638,225.19	19.33
43	002244	滨江集团	17,596,124.31	19.29
44	601908	京运通	17,348,098.90	19.02
45	600298	安琪酵母	17,317,291.19	18.98
46	300160	秀强股份	16,854,897.37	18.48
47	002311	海大集团	16,839,710.10	18.46
48	002477	雏鹰农牧	16,537,494.36	18.13
49	000965	天保基建	16,531,770.53	18.12
50	000900	现代投资	16,424,605.18	18.00
51	601636	旗滨集团	16,409,484.43	17.99
52	002768	国恩股份	16,390,823.93	17.97
53	600258	首旅酒店	16,283,614.34	17.85
54	300161	华中数控	16,128,934.00	17.68
55	600028	中国石化	16,104,838.05	17.65
56	601588	北辰实业	15,870,802.24	17.40
57	600508	上海能源	15,690,072.49	17.20
58	000059	华锦股份	15,677,070.25	17.18
59	002182	云海金属	15,636,095.94	17.14
60	002596	海南瑞泽	15,487,261.53	16.98
61	002677	浙江美大	15,416,384.33	16.90
62	600771	广誉远	15,376,588.96	16.86
63	000983	西山煤电	15,268,414.50	16.74
64	000419	通程控股	15,248,985.93	16.72
65	600261	阳光照明	15,049,300.52	16.50
66	002356	赫美集团	15,020,515.50	16.46
67	002270	华明装备	14,982,606.61	16.42
68	002746	仙坛股份	14,916,171.47	16.35
69	600684	珠江实业	14,900,385.21	16.33
70	002638	勤上光电	14,850,900.90	16.28
71	000926	福星股份	14,779,732.78	16.20
72	300316	晶盛机电	14,757,690.47	16.18
73	300164	通源石油	14,673,375.69	16.08
74	300031	宝通科技	14,643,406.46	16.05
75	601666	平煤股份	14,538,709.50	15.94
76	603085	天成自控	14,489,644.06	15.88
77	300048	合康新能	14,423,642.68	15.81
78	300201	海伦哲	14,377,866.82	15.76

79	000936	华西股份	14,322,791.46	15.70
80	600157	永泰能源	14,201,224.33	15.57
81	600010	包钢股份	14,155,501.18	15.52
82	002572	索菲亚	14,125,125.24	15.48
83	000709	河钢股份	14,097,593.47	15.45
84	000909	数源科技	13,899,091.90	15.24
85	002218	拓日新能	13,853,127.05	15.19
86	002410	广联达	13,746,765.71	15.07
87	300091	金通灵	13,705,171.89	15.02
88	000023	深天地A	13,681,257.74	15.00
89	300283	温州宏丰	13,611,246.76	14.92
90	002114	罗平锌电	13,529,060.00	14.83
91	300322	硕贝德	13,481,128.52	14.78
92	300342	天银机电	13,447,659.76	14.74
93	002597	金禾实业	13,257,596.83	14.53
94	002188	巴士在线	13,240,268.54	14.51
95	000820	神雾节能	13,223,813.70	14.50
96	601677	明泰铝业	13,217,606.31	14.49
97	300509	新美星	13,161,404.97	14.43
98	002003	伟星股份	13,036,414.91	14.29
99	002607	亚夏汽车	13,018,771.51	14.27
100	300259	新天科技	12,978,125.62	14.23
101	603616	韩建河山	12,952,988.96	14.20
102	002511	中顺洁柔	12,943,930.77	14.19
103	002295	精艺股份	12,864,961.07	14.10
104	002518	科士达	12,830,823.24	14.06
105	300341	麦迪电气	12,827,233.82	14.06
106	603609	禾丰牧业	12,800,045.52	14.03
107	002427	尤夫股份	12,728,675.47	13.95
108	300457	赢合科技	12,725,117.45	13.95
109	001979	招商蛇口	12,719,851.85	13.94
110	002255	海陆重工	12,679,231.68	13.90
111	300182	捷成股份	12,344,491.44	13.53
112	300118	东方日升	12,256,946.50	13.44
113	000502	绿景控股	12,193,105.14	13.37
114	601155	新城控股	12,190,218.09	13.36
115	002781	奇信股份	12,146,934.36	13.31
116	600287	江苏舜天	12,000,610.87	13.15

117	603979	金诚信	11,977,575.18	13.13
118	002502	骅威文化	11,937,138.24	13.08
119	000046	泛海控股	11,766,657.28	12.90
120	002128	露天煤业	11,671,266.15	12.79
121	002508	老板电器	11,616,388.00	12.73
122	600839	四川长虹	11,547,810.00	12.66
123	300230	永利股份	11,503,513.48	12.61
124	300274	阳光电源	11,453,059.48	12.55
125	002193	山东如意	11,430,341.38	12.53
126	600737	中粮屯河	11,423,441.16	12.52
127	603818	曲美家居	11,359,332.81	12.45
128	002394	联发股份	11,330,661.00	12.42
129	300409	道氏技术	11,224,547.15	12.30
130	000825	太钢不锈	11,126,643.72	12.20
131	002100	天康生物	11,071,740.93	12.14
132	600362	江西铜业	11,044,438.22	12.11
133	002084	海鸥卫浴	10,992,427.00	12.05
134	600690	青岛海尔	10,945,240.00	12.00
135	601233	桐昆股份	10,922,299.72	11.97
136	300476	胜宏科技	10,850,887.30	11.89
137	300279	和晶科技	10,825,010.57	11.87
138	300247	乐金健康	10,745,021.00	11.78
139	603026	石大胜华	10,670,129.90	11.70
140	601001	大同煤业	10,650,723.98	11.67
141	300307	慈星股份	10,604,098.55	11.62
142	002458	益生股份	10,492,042.99	11.50
143	002285	世联行	10,465,005.17	11.47
144	002480	新筑股份	10,417,206.00	11.42
145	603686	龙马环卫	10,403,511.30	11.40
146	002057	中钢天源	10,283,231.31	11.27
147	300042	朗科科技	10,204,527.21	11.19
148	603088	宁波精达	10,181,713.13	11.16
149	002080	中材科技	10,067,273.99	11.04
150	603566	普莱柯	10,026,654.47	10.99
151	600382	广东明珠	9,994,043.30	10.95
152	002279	久其软件	9,990,182.94	10.95
153	002548	金新农	9,943,223.78	10.90
154	601717	郑煤机	9,917,130.27	10.87

155	000060	中金岭南	9,906,996.76	10.86
156	600022	山东钢铁	9,889,996.00	10.84
157	000526	紫光学大	9,886,550.79	10.84
158	002380	科远股份	9,696,980.41	10.63
159	300370	安控科技	9,681,495.70	10.61
160	002171	楚江新材	9,666,478.15	10.60
161	300258	精锻科技	9,662,509.80	10.59
162	002716	金贵银业	9,648,629.50	10.58
163	000627	天茂集团	9,622,100.42	10.55
164	300138	晨光生物	9,523,093.42	10.44
165	600736	苏州高新	9,502,203.10	10.42
166	002144	宏达高科	9,429,345.69	10.34
167	000030	富奥股份	9,428,621.00	10.34
168	002301	齐心集团	9,381,837.63	10.28
169	002296	辉煌科技	9,298,328.54	10.19
170	002684	猛狮科技	9,291,174.78	10.18
171	002124	天邦股份	9,260,309.29	10.15
172	002771	真视通	9,251,990.25	10.14
173	002147	新光圆成	9,251,581.68	10.14
174	601965	中国汽研	9,244,654.93	10.13
175	002213	特尔佳	9,242,203.00	10.13
176	000572	海马汽车	9,163,945.77	10.05
177	600162	香江控股	9,098,642.52	9.97
178	300008	天海防务	9,074,441.62	9.95
179	601886	江河集团	9,034,715.60	9.90
180	002604	龙力生物	8,995,566.86	9.86
181	000055	方大集团	8,836,173.78	9.69
182	002155	湖南黄金	8,818,605.43	9.67
183	603027	千禾味业	8,797,251.88	9.64
184	300112	万讯自控	8,786,313.58	9.63
185	002235	安妮股份	8,760,541.01	9.60
186	600503	华丽家族	8,752,765.00	9.59
187	002232	启明信息	8,728,748.07	9.57
188	600282	南钢股份	8,712,350.48	9.55
189	002200	云投生态	8,701,973.79	9.54
190	603919	金徽酒	8,653,928.85	9.49
191	002366	台海核电	8,650,046.84	9.48
192	601388	怡球资源	8,639,593.00	9.47

193	300063	天龙集团	8,627,864.00	9.46
194	002035	华帝股份	8,556,022.18	9.38
195	600051	宁波联合	8,517,103.86	9.34
196	002041	登海种业	8,470,896.35	9.29
197	300475	聚隆科技	8,447,104.32	9.26
198	002543	万和电气	8,407,656.13	9.22
199	000938	紫光股份	8,352,777.00	9.16
200	300373	扬杰科技	8,331,857.60	9.13
201	300177	中海达	8,309,451.50	9.11
202	002532	新界泵业	8,219,066.29	9.01
203	002760	凤形股份	8,204,600.44	8.99
204	002529	海源机械	8,196,860.68	8.98
205	002598	山东章鼓	8,189,087.75	8.98
206	002750	龙津药业	8,154,094.00	8.94
207	002757	南兴装备	8,149,076.97	8.93
208	002149	西部材料	8,068,732.23	8.84
209	002718	友邦吊顶	8,061,689.60	8.84
210	300140	启源装备	7,975,288.67	8.74
211	601137	博威合金	7,950,614.46	8.72
212	002107	沃华医药	7,936,768.43	8.70
213	600309	万华化学	7,931,537.20	8.69
214	000876	新希望	7,869,002.66	8.63
215	300200	高盟新材	7,849,483.52	8.60
216	600668	尖峰集团	7,812,279.47	8.56
217	603020	爱普股份	7,729,321.00	8.47
218	002403	爱仕达	7,651,851.21	8.39
219	600586	金晶科技	7,636,670.69	8.37
220	600395	盘江股份	7,628,000.90	8.36
221	600090	同济堂	7,621,043.08	8.35
222	603306	华懋科技	7,605,897.65	8.34
223	300231	银信科技	7,599,018.34	8.33
224	002083	孚日股份	7,597,862.57	8.33
225	300448	浩云科技	7,572,468.16	8.30
226	000036	华联控股	7,534,706.73	8.26
227	300214	日科化学	7,477,782.69	8.20
228	002713	东易日盛	7,449,697.01	8.17
229	600073	上海梅林	7,445,374.29	8.16
230	600981	汇鸿集团	7,437,732.23	8.15

231	300246	宝莱特	7,413,184.94	8.13
232	600816	安信信托	7,392,739.92	8.10
233	002435	长江润发	7,354,243.46	8.06
234	002545	东方铁塔	7,352,194.37	8.06
235	600220	江苏阳光	7,295,287.57	8.00
236	300287	飞利信	7,229,876.61	7.93
237	000096	广聚能源	7,153,340.49	7.84
238	002308	威创股份	7,125,917.14	7.81
239	600626	申达股份	7,108,498.22	7.79
240	002646	青青稞酒	7,091,052.02	7.77
241	603898	好莱客	7,013,693.48	7.69
242	300209	天泽信息	6,993,031.68	7.67
243	600595	中孚实业	6,992,187.55	7.66
244	600743	华远地产	6,930,870.64	7.60
245	300097	智云股份	6,887,894.99	7.55
246	300387	富邦股份	6,862,297.82	7.52
247	600482	中国动力	6,811,788.79	7.47
248	300248	新开普	6,808,318.48	7.46
249	601567	三星医疗	6,785,684.91	7.44
250	002463	沪电股份	6,697,971.27	7.34
251	002260	德奥通航	6,666,371.68	7.31
252	000979	中弘股份	6,665,956.00	7.31
253	002372	伟星新材	6,660,473.63	7.30
254	002259	升达林业	6,543,128.74	7.17
255	603100	川仪股份	6,537,878.94	7.17
256	002323	雅百特	6,537,842.74	7.17
257	300192	科斯伍德	6,499,480.21	7.12
258	000620	新华联	6,457,732.91	7.08
259	002401	中海科技	6,430,324.73	7.05
260	000506	中润资源	6,422,100.14	7.04
261	300304	云意电气	6,407,662.33	7.02
262	603366	日出东方	6,368,600.64	6.98
263	300194	福安药业	6,364,093.42	6.98
264	002090	金智科技	6,355,925.90	6.97
265	600064	南京高科	6,328,372.35	6.94
266	603030	全筑股份	6,290,933.29	6.90
267	002302	西部建设	6,285,741.20	6.89
268	300018	中元股份	6,275,790.27	6.88

269	002609	捷顺科技	6,228,651.04	6.83
270	002290	禾盛新材	6,213,297.61	6.81
271	000663	永安林业	6,199,747.27	6.80
272	002441	众业达	6,175,387.17	6.77
273	601777	力帆股份	6,146,078.00	6.74
274	600657	信达地产	6,140,402.96	6.73
275	600327	大东方	6,110,772.32	6.70
276	300375	鹏翎股份	6,109,362.77	6.70
277	002662	京威股份	6,086,331.00	6.67
278	600325	华发股份	6,080,972.82	6.67
279	000732	泰禾集团	6,030,044.11	6.61
280	002418	康盛股份	5,968,763.25	6.54
281	300250	初灵信息	5,957,305.63	6.53
282	300119	瑞普生物	5,947,343.35	6.52
283	600805	悦达投资	5,929,400.50	6.50
284	600624	复旦复华	5,872,809.79	6.44
285	300196	长海股份	5,871,957.14	6.44
286	600128	弘业股份	5,827,717.18	6.39
287	000816	智慧农业	5,825,496.73	6.39
288	601992	金隅股份	5,812,444.47	6.37
289	300170	汉得信息	5,790,280.84	6.35
290	601238	广汽集团	5,784,198.45	6.34
291	300141	和顺电气	5,783,534.68	6.34
292	600748	上实发展	5,746,717.05	6.30
293	300260	新莱应材	5,727,720.74	6.28
294	002177	御银股份	5,714,192.66	6.26
295	002438	江苏神通	5,711,585.40	6.26
296	002367	康力电梯	5,683,083.70	6.23
297	300158	振东制药	5,672,208.47	6.22
298	300360	炬华科技	5,652,287.09	6.20
299	600354	敦煌种业	5,637,013.28	6.18
300	300129	泰胜风能	5,635,048.31	6.18
301	300023	宝德股份	5,630,744.52	6.17
302	000609	绵石投资	5,613,625.51	6.15
303	000937	冀中能源	5,612,700.00	6.15
304	002615	哈尔斯	5,606,835.13	6.15
305	002583	海能达	5,596,942.24	6.14
306	002300	太阳电缆	5,590,139.94	6.13

307	002623	亚玛顿	5,582,859.32	6.12
308	000426	兴业矿业	5,529,332.00	6.06
309	600409	三友化工	5,504,500.00	6.03
310	002726	龙大肉食	5,491,831.23	6.02
311	600770	综艺股份	5,452,381.99	5.98
312	600702	沱牌舍得	5,447,477.12	5.97
313	300416	苏试试验	5,401,310.68	5.92
314	300305	裕兴股份	5,351,088.33	5.87
315	601100	恒立液压	5,337,778.60	5.85
316	600853	龙建股份	5,333,438.12	5.85
317	000070	特发信息	5,331,470.71	5.84
318	601898	中煤能源	5,323,806.94	5.84
319	000514	渝开发	5,167,608.03	5.66
320	300286	安科瑞	5,135,488.24	5.63
321	300270	中威电子	5,116,025.07	5.61
322	002305	南国置业	5,073,965.73	5.56
323	600348	阳泉煤业	5,057,448.68	5.54
324	603377	东方时尚	5,054,446.50	5.54
325	603355	莱克电气	5,051,714.93	5.54
326	600695	绿庭投资	5,047,406.93	5.53
327	600648	外高桥	5,044,342.96	5.53
328	002226	江南化工	5,024,351.33	5.51
329	000425	徐工机械	5,001,150.00	5.48
330	002743	富煌钢构	4,967,643.30	5.45
331	002487	大金重工	4,966,752.27	5.44
332	300452	山河药辅	4,918,658.36	5.39
333	300093	金刚玻璃	4,917,870.40	5.39
334	300213	佳讯飞鸿	4,907,012.59	5.38
335	300306	远方光电	4,906,862.34	5.38
336	300074	华平股份	4,904,858.04	5.38
337	603869	北部湾旅	4,899,880.48	5.37
338	002523	天桥起重	4,873,614.01	5.34
339	002309	中利科技	4,848,062.20	5.31
340	600615	丰华股份	4,845,966.19	5.31
341	300272	开能环保	4,828,610.14	5.29
342	002553	南方轴承	4,819,416.16	5.28
343	600159	大龙地产	4,803,677.94	5.27
344	600284	浦东建设	4,779,764.89	5.24

345	600638	新黄浦	4,775,557.77	5.23
346	002150	通润装备	4,756,006.66	5.21
347	000969	安泰科技	4,753,678.41	5.21
348	002765	蓝黛传动	4,690,740.42	5.14
349	000151	中成股份	4,679,741.28	5.13
350	600322	天房发展	4,675,458.10	5.12
351	002554	惠博普	4,644,218.00	5.09
352	000587	金洲慈航	4,625,348.09	5.07
353	000789	万年青	4,587,831.21	5.03
354	000551	创元科技	4,576,813.96	5.02
355	600823	世茂股份	4,557,383.11	5.00
356	300021	大禹节水	4,551,149.81	4.99
357	600973	宝胜股份	4,514,988.74	4.95
358	000421	南京公用	4,510,914.72	4.94
359	603003	龙宇燃油	4,500,734.48	4.93
360	601616	广电电气	4,496,992.29	4.93
361	002216	三全食品	4,482,115.54	4.91
362	300253	卫宁健康	4,471,814.78	4.90
363	300121	阳谷华泰	4,459,442.14	4.89
364	000698	沈阳化工	4,456,833.72	4.89
365	600093	禾嘉股份	4,447,061.99	4.87
366	603017	中衡设计	4,443,131.31	4.87
367	000032	深桑达A	4,418,512.17	4.84
368	300064	豫金刚石	4,411,473.18	4.84
369	300394	天孚通信	4,391,781.98	4.81
370	002123	梦网荣信	4,391,531.56	4.81
371	600971	恒源煤电	4,384,221.35	4.81
372	600123	兰花科创	4,367,984.00	4.79
373	300343	联创互联	4,365,505.00	4.79
374	300022	吉峰农机	4,308,996.77	4.72
375	002238	天威视讯	4,307,156.08	4.72
376	600231	凌钢股份	4,300,192.00	4.71
377	603789	星光农机	4,295,578.00	4.71
378	600060	海信电器	4,280,401.63	4.69
379	002321	华英农业	4,266,076.88	4.68
380	600359	新农开发	4,260,934.22	4.67
381	002578	闽发铝业	4,250,830.91	4.66
382	600433	冠豪高新	4,245,005.16	4.65

383	601339	百隆东方	4,227,683.41	4.63
384	002756	永兴特钢	4,226,543.65	4.63
385	600846	同济科技	4,184,862.01	4.59
386	300136	信维通信	4,181,877.70	4.58
387	600889	南京化纤	4,167,086.00	4.57
388	300211	亿通科技	4,150,875.06	4.55
389	600223	鲁商置业	4,141,887.56	4.54
390	600240	华业资本	4,121,936.01	4.52
391	600531	豫光金铅	4,105,562.48	4.50
392	600651	飞乐音响	4,098,087.62	4.49
393	603688	石英股份	4,092,809.76	4.49
394	002225	濮耐股份	4,087,706.18	4.48
395	600683	京投发展	4,076,009.74	4.47
396	000541	佛山照明	4,069,447.11	4.46
397	600291	西水股份	4,063,548.98	4.45
398	300029	天龙光电	4,047,128.36	4.44
399	603988	中电电机	4,045,367.51	4.43
400	000821	京山轻机	4,029,119.41	4.42
401	603099	长白山	4,025,808.26	4.41
402	300498	温氏股份	4,011,879.95	4.40
403	002221	东华能源	4,009,730.82	4.40
404	300389	艾比森	4,000,082.82	4.38
405	600133	东湖高新	3,975,493.62	4.36
406	600148	长春一东	3,956,811.93	4.34
407	600268	国电南自	3,956,493.60	4.34
408	600537	亿晶光电	3,944,231.40	4.32
409	000735	罗牛山	3,936,593.50	4.32
410	600103	青山纸业	3,936,390.39	4.31
411	600612	老凤祥	3,933,390.61	4.31
412	600336	澳柯玛	3,933,120.23	4.31
413	600337	美克家居	3,919,888.89	4.30
414	002729	好利来	3,904,446.00	4.28
415	000680	山推股份	3,859,485.00	4.23
416	002151	北斗星通	3,846,184.98	4.22
417	000795	英洛华	3,788,483.00	4.15
418	600185	格力地产	3,769,999.78	4.13
419	300269	联建光电	3,731,801.18	4.09
420	600299	安迪苏	3,727,748.24	4.09

421	603311	金海环境	3,703,842.34	4.06
422	300329	海伦钢琴	3,698,248.15	4.05
423	600373	中文传媒	3,671,719.31	4.02
424	600815	厦工股份	3,662,941.12	4.02
425	600723	首商股份	3,654,090.21	4.01
426	002167	东方锆业	3,641,531.59	3.99
427	300444	双杰电气	3,635,620.36	3.99
428	002503	搜于特	3,631,971.16	3.98
429	002093	国脉科技	3,617,594.51	3.97
430	300483	沃施股份	3,571,206.00	3.91
431	300151	昌红科技	3,570,807.72	3.91
432	002388	新亚制程	3,560,090.46	3.90
433	002707	众信旅游	3,542,814.00	3.88
434	000422	湖北宜化	3,540,806.00	3.88
435	300354	东华测试	3,540,664.73	3.88
436	002062	宏润建设	3,539,692.84	3.88
437	002334	英威腾	3,538,348.89	3.88
438	603008	喜临门	3,535,554.05	3.88
439	000878	云南铜业	3,532,304.90	3.87
440	603969	银龙股份	3,516,197.00	3.85
441	002446	盛路通信	3,513,361.10	3.85
442	600477	杭萧钢构	3,510,341.35	3.85
443	000971	高升控股	3,500,911.80	3.84
444	002666	德联集团	3,491,863.00	3.83
445	600201	生物股份	3,483,658.33	3.82
446	600416	湘电股份	3,477,633.14	3.81
447	002613	北玻股份	3,459,178.91	3.79
448	002600	江粉磁材	3,456,795.50	3.79
449	000877	天山股份	3,420,178.00	3.75
450	002039	黔源电力	3,356,818.85	3.68
451	600188	兖州煤业	3,355,347.90	3.68
452	000056	皇庭国际	3,339,511.11	3.66
453	600757	长江传媒	3,330,167.68	3.65
454	600730	中国高科	3,301,060.00	3.62
455	600167	联美控股	3,285,118.76	3.60
456	600525	长园集团	3,280,329.00	3.60
457	002282	博深工具	3,279,074.36	3.59
458	600448	华纺股份	3,266,275.11	3.58

459	300069	金利华电	3,263,122.72	3.58
460	300183	东软载波	3,257,757.98	3.57
461	000066	长城电脑	3,241,301.00	3.55
462	601208	东材科技	3,238,000.16	3.55
463	603006	黎明股份	3,233,799.32	3.54
464	002674	兴业科技	3,233,081.63	3.54
465	002078	太阳纸业	3,229,927.53	3.54
466	600138	中青旅	3,206,468.00	3.51
467	600308	华泰股份	3,167,584.69	3.47
468	002671	龙泉股份	3,165,359.16	3.47
469	000807	云铝股份	3,134,405.00	3.44
470	002670	国盛金控	3,098,071.67	3.40
471	000882	华联股份	3,082,960.00	3.38
472	600599	熊猫金控	3,074,608.88	3.37
473	600361	华联综超	3,067,374.74	3.36
474	600784	鲁银投资	3,066,775.20	3.36
475	002382	蓝帆医疗	3,052,258.54	3.35
476	600425	青松建化	3,044,698.00	3.34
477	600881	亚泰集团	3,038,904.91	3.33
478	002575	群兴玩具	3,033,297.00	3.32
479	002006	精功科技	3,027,014.50	3.32
480	002628	成都路桥	3,024,289.00	3.32
481	600975	新五丰	3,021,551.00	3.31
482	300145	中金环境	3,015,165.52	3.31
483	002538	司尔特	3,007,470.67	3.30
484	300234	开尔新材	2,997,180.83	3.29
485	300471	厚普股份	2,980,958.05	3.27
486	600067	冠城大通	2,980,594.99	3.27
487	002234	民和股份	2,975,907.16	3.26
488	000404	华意压缩	2,965,450.93	3.25
489	600059	古越龙山	2,964,771.00	3.25
490	300271	华宇软件	2,962,740.61	3.25
491	600630	龙头股份	2,958,249.00	3.24
492	002051	中工国际	2,948,815.72	3.23
493	000682	东方电子	2,931,994.68	3.21
494	600861	北京城乡	2,929,149.74	3.21
495	000701	厦门信达	2,895,490.09	3.17
496	600755	厦门国贸	2,892,843.26	3.17

497	002176	江特电机	2,892,535.60	3.17
498	002560	通达股份	2,890,810.00	3.17
499	600801	华新水泥	2,874,329.70	3.15
500	600665	天地源	2,867,387.92	3.14
501	600658	电子城	2,854,448.41	3.13
502	000890	法尔胜	2,835,559.60	3.11
503	600280	中央商场	2,821,810.64	3.09
504	601098	中南传媒	2,725,339.71	2.99
505	002220	天宝股份	2,724,445.33	2.99
506	600222	太龙药业	2,688,584.34	2.95
507	600782	新钢股份	2,683,423.00	2.94
508	600523	贵航股份	2,626,979.74	2.88
509	600370	三房巷	2,626,362.26	2.88
510	300089	文化长城	2,623,494.50	2.88
511	600313	农发种业	2,620,473.95	2.87
512	600802	福建水泥	2,597,676.82	2.85
513	000418	小天鹅A	2,591,443.02	2.84
514	300144	宋城演艺	2,574,892.84	2.82
515	000488	晨鸣纸业	2,573,803.38	2.82
516	600126	杭钢股份	2,567,387.00	2.81
517	600192	长城电工	2,554,498.80	2.80
518	002641	永高股份	2,531,323.33	2.77
519	600888	新疆众和	2,526,920.24	2.77
520	300311	任子行	2,520,549.46	2.76
521	300143	星河生物	2,515,847.40	2.76
522	300367	东方网力	2,500,778.50	2.74
523	600742	一汽富维	2,500,706.00	2.74
524	300301	长方集团	2,497,505.73	2.74
525	300107	建新股份	2,482,867.66	2.72
526	000726	鲁泰A	2,469,569.00	2.71
527	600398	海澜之家	2,468,766.00	2.71
528	000546	金圆股份	2,451,527.77	2.69
529	002026	山东威达	2,446,967.96	2.68
530	603025	大豪科技	2,445,931.22	2.68
531	600070	浙江富润	2,424,857.67	2.66
532	002491	通鼎互联	2,394,550.74	2.62
533	600850	华东电脑	2,389,945.52	2.62
534	300378	鼎捷软件	2,334,184.00	2.56

535	002648	卫星石化	2,334,053.79	2.56
536	300303	聚飞光电	2,310,965.14	2.53
537	000813	德展健康	2,293,182.73	2.51
538	600353	旭光股份	2,282,982.18	2.50
539	600248	延长化建	2,275,692.13	2.49
540	000888	峨眉山A	2,262,924.21	2.48
541	603338	浙江鼎力	2,255,065.96	2.47
542	600810	神马股份	2,221,306.42	2.43
543	300175	朗源股份	2,196,048.71	2.41
544	300478	杭州高新	2,195,673.00	2.41
545	600510	黑牡丹	2,172,924.88	2.38
546	300333	兆日科技	2,163,031.05	2.37
547	000656	金科股份	2,134,357.00	2.34
548	600605	汇通能源	2,130,552.30	2.34
549	300065	海兰信	2,130,094.09	2.33
550	000603	盛达矿业	2,129,207.80	2.33
551	600467	好当家	2,123,977.00	2.33
552	002027	分众传媒	2,121,248.93	2.33
553	000619	海螺型材	2,119,549.66	2.32
554	002510	天汽模	2,119,451.98	2.32
555	600983	惠而浦	2,110,707.74	2.31
556	002157	正邦科技	2,110,254.88	2.31
557	300076	GQY 视讯	2,109,504.62	2.31
558	002451	摩恩电气	2,104,540.00	2.31
559	600077	宋都股份	2,090,737.77	2.29
560	300207	欣旺达	2,090,388.94	2.29
561	600191	华资实业	2,082,669.02	2.28
562	002731	萃华珠宝	2,077,381.36	2.28
563	000593	大通燃气	2,062,344.23	2.26
564	002606	大连电瓷	2,044,445.94	2.24
565	300302	同有科技	2,039,573.00	2.24
566	002476	宝莫股份	2,036,830.00	2.23
567	600387	海越股份	2,033,298.00	2.23
568	000778	新兴铸管	2,025,679.07	2.22
569	300255	常山药业	2,022,704.48	2.22
570	002233	塔牌集团	2,017,230.61	2.21
571	600778	友好集团	2,016,516.00	2.21
572	600290	华仪电气	2,015,465.68	2.21

573	600681	百川能源	2,009,110.81	2.20
574	601007	金陵饭店	2,004,669.32	2.20
575	000671	阳光城	2,000,617.54	2.19
576	000889	茂业通信	1,996,665.29	2.19
577	600239	云南城投	1,992,383.99	2.18
578	002561	徐家汇	1,979,898.82	2.17
579	002042	华孚色纺	1,968,620.13	2.16
580	300261	雅本化学	1,959,921.38	2.15
581	000567	海德股份	1,956,459.00	2.14
582	000903	云内动力	1,951,357.88	2.14
583	600058	五矿发展	1,938,054.00	2.12
584	300345	红宇新材	1,937,369.69	2.12
585	002495	佳隆股份	1,935,227.40	2.12
586	000713	丰乐种业	1,932,521.94	2.12
587	300243	瑞丰高材	1,929,572.00	2.12
588	000061	农产品	1,915,422.99	2.10
589	000850	华茂股份	1,902,620.00	2.09
590	300157	恒泰艾普	1,898,977.00	2.08
591	002425	凯撒文化	1,886,998.95	2.07
592	002772	众兴菌业	1,874,762.74	2.06
593	002262	恩华药业	1,837,787.26	2.01
594	000919	金陵药业	1,829,782.00	2.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,489,841,099.71
卖出股票收入（成交）总额	4,882,582,997.61

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资将以套期保值为目的，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。具体股指期货投资策略包括：（a）对冲投资组合的系统性风险；（b）有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	442,222.70
2	应收证券清算款	68,247.58
3	应收股利	-
4	应收利息	38,370.97
5	应收申购款	26,758,409.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,307,251.12

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
47,026	17,974.36	334,196,426.69	39.54%	511,065,832.80	60.46%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,124,283.88	0.2513%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012年5月23日）基金份额总额	552,581,237.45
本报告期期初基金份额总额	38,290,067.32
本报告期基金总申购份额	1,006,085,244.25
减:本报告期基金总赎回份额	199,113,052.08
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	845,262,259.49

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2016年12月，基金管理人职工代表大会决议公布：廖仁勇、葛文娜担任公司新一届监事会职工监事，王泉、邓艺颖不再担任职工监事。监事会其余成员保持不变。

2、2016年12月，基金管理人股东会决议：刁锋担任公司新一届董事会董事，孙泉不再担任董事；张建强、查卡拉·西索瓦、樸睿波担任新一届董事会独立董事，汪丁丁、周小明、杜英华不再担任独立董事。董事会其余成员保持不变。

3、本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为 6 万元，该审计机构对本基金提供的审计服务的连续年限为 5 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	26	192,162,075.40	54.47%	5,766,771.37	54.47%	-
海通证券	12	156,704,887.12	18.97%	2,008,548.87	18.97%	-
光大证券	11	922,283,045.30	16.91%	1,790,228.50	16.91%	-
华创证券	1	585,839,134.42	5.15%	545,590.44	5.15%	-
东方证券	2	419,284,748.56	3.69%	390,475.72	3.69%	-
中泰证券	2	55,303,781.57	0.49%	51,504.21	0.49%	-
申万宏源	2	37,210,812.67	0.33%	34,654.13	0.33%	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

国信证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	3	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	3	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

(一) 2016 年本基金新增财富证券交易单元。

(二) 交易单元选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要；
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期末租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利基金管理有限公司关于泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金分红公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2016 年 10 月 31 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662。

泰达宏利基金管理有限公司
2017年3月30日