

# 红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式 证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：红塔红土基金管理有限公司

基金托管人：广州农村商业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人广州农村商业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	48
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
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.....	83
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.....	83
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.....	83
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.....	83
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	83
7.12 投资组合报告附注.....	84
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>85</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	85
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	86
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	86
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>87</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>88</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	88
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.....	88
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	88
10.4 基金投资策略的改变.....	88
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	88
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.....	88
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	88
10.8 其他重大事件.....	89

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>91</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	91
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>92</b>
12.1 备查文件目录.....	92
12.2 存放地点.....	92
12.3 查阅方式.....	92

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	红塔红土优质成长	
场内简称	-	
基金主代码	001673	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 8 月 6 日	
基金管理人	红塔红土基金管理有限公司	
基金托管人	广州农村商业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	214,155,189.07 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	001673	001674
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	213,473,373.46 份	681,815.61 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对个股基本面的价值分析精选个股，通过对宏观经济周期阶段的分析确定股票资产和债券资产等各类资产的中长期配置，通过行为金融学对市场短期风格的分析确定短期行业配置，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动地资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。	
投资策略	本基金投资策略包括大类资产配置策略、股票资产投资策略、债券及其它金融工具投资策略几个部分。	
业绩比较基准	沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种，本基金的预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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		红塔红土基金管理有限公司	广州农村商业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李凌	曹婧
	联系电话	0755-33379079	-
	电子邮箱	liling@htamc.com.cn	caojing@grcbank.com
客户服务电话		4001-666-916（免长途话费）	95313
传真		0755-33379007	020-28019340
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）	广州市天河区珠江新城华夏路1号
办公地址		深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801	广州市天河区珠江新城华夏路1号
邮政编码		518052	510623
法定代表人		饶雄	王继康

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》、《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.htamc.com.cn">http://www.htamc.com.cn</a>
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	红塔红土基金管理有限公司	深圳市南山区侨香路4068号智慧广场A栋801

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-10,250,451.92	-34,247.28
本期利润	-617,727.74	-4,991.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0028	-0.0074
本期加权平均净值利润率	-0.29%	-0.76%
本期基金份额净值增长率	-0.54%	-0.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)	
期末可供分配利润	-12,770,515.93	-43,142.02
期末可供分配基金份额利润	-0.0598	-0.0633
期末基金资产净值	209,310,178.07	666,027.97
期末基金份额净值	0.9805	0.9768
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.95%	-2.32%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益是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

##### 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

红塔红土优质成长 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.53%	0.46%	3.21%	0.38%	1.32%	0.08%
过去三个月	0.60%	0.59%	3.28%	0.36%	-2.68%	0.23%
过去六个月	-0.54%	0.54%	5.53%	0.33%	-6.07%	0.21%
过去一年	3.10%	0.52%	8.44%	0.39%	-5.34%	0.13%
自基金合同	-1.95%	0.95%	0.59%	0.84%	-2.54%	0.11%



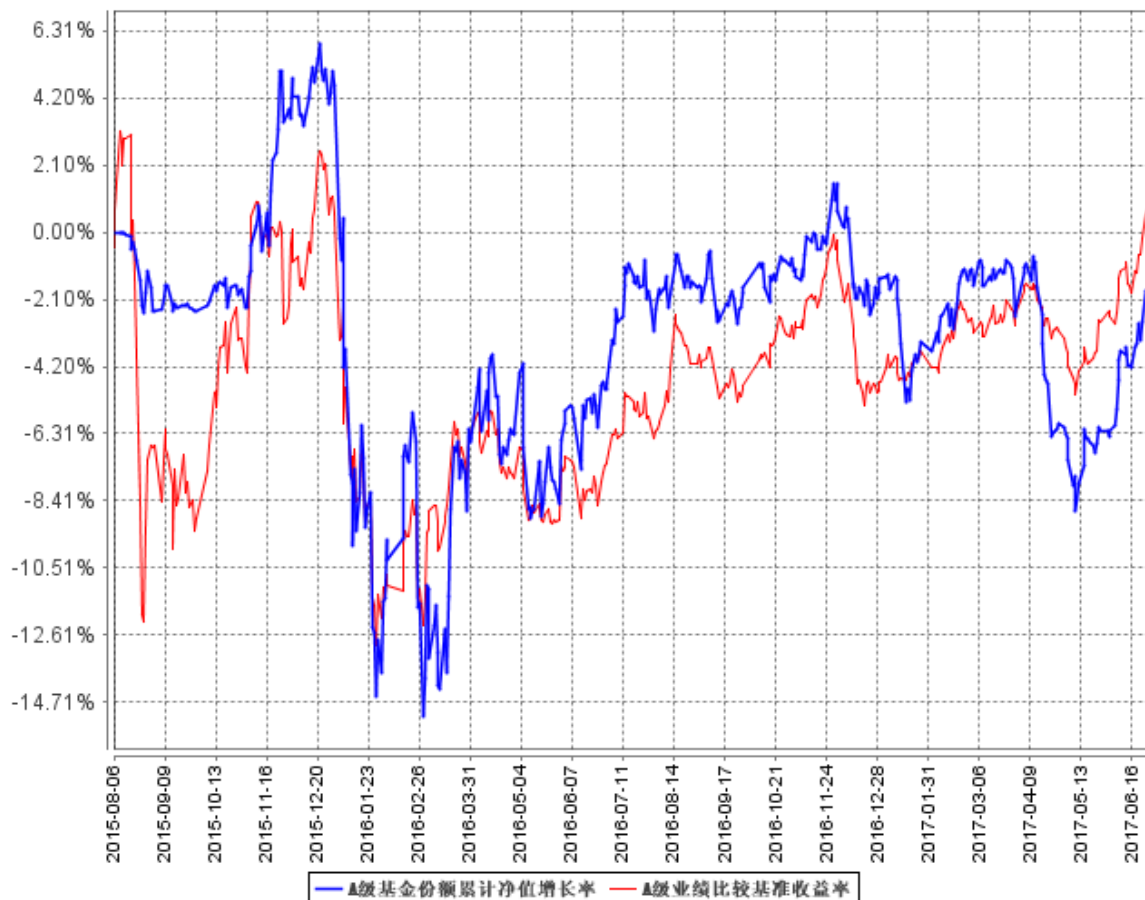
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

红塔红土优质成长 C

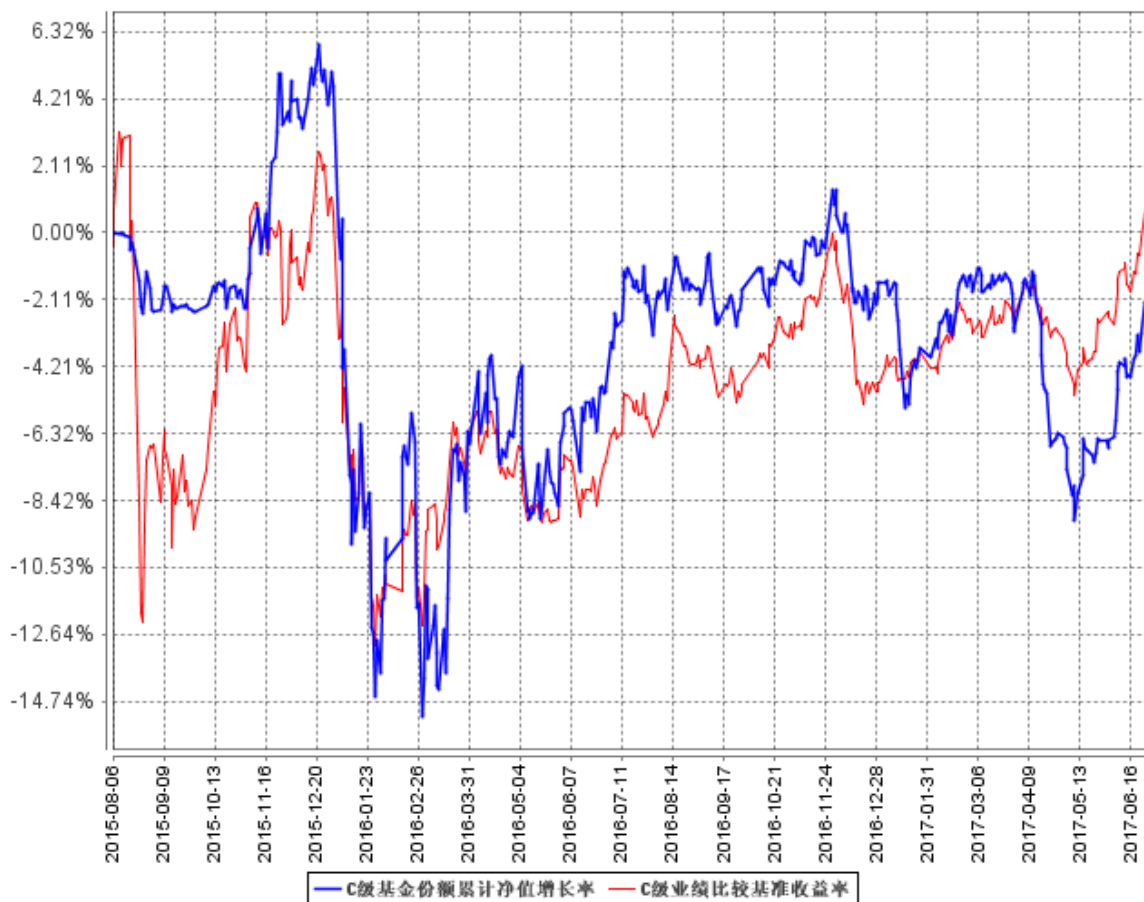
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.50%	0.46%	3.21%	0.38%	1.29%	0.08%
过去三个月	0.69%	0.58%	3.28%	0.36%	-2.59%	0.22%
过去六个月	-0.75%	0.54%	5.53%	0.33%	-6.28%	0.21%
过去一年	2.84%	0.52%	8.44%	0.39%	-5.60%	0.13%
自基金合同生效起至今	-2.32%	0.95%	0.59%	0.84%	-2.91%	0.11%

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

A级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



C级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



### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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

本基金管理人为红塔红土基金管理有限公司（简称“公司”），经中国证券监督管理委员会批准，于 2012 年 6 月 12 日正式成立，注册地位于深圳前海，注册资本 2 亿元人民币。其中，红塔证券股份有限公司出资比例为 49%，深圳市创新投资集团有限公司出资比例为 26%，北京市华远集团有限公司出资比例为 25%。公司业务范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理及中国证监会许可的其他业务。

作为一家为客户提供专业投资服务的资产管理机构，公司将坚持价值投资理念，以专业服务回馈社会，建立并不断完善投研一体化平台，坚持把基金持有人利益放在首位，努力实现基金持有人资产增值。同时，重视投资的风险控制，建立起一套全面完善的风险管理体系，以风险预算为基础，合法合规运作为前提，将风险控制贯穿于整个投资运作的全过程，进而实现专业组合投资。截止 2017 年 06 月 30 日，公司有员工 39 人，其中 24 人具有硕士或博士学位；截止 2017 年 6 月 30 日，公司管理 7 只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
赵耀	基金经理	2015 年 8 月 6 日	2017 年 3 月 2 日	13	香港中文大学金融财务工商管理硕士，厦门大学经济学学士，CFA（美国注册金融分析师）。近 13 年证券、基金从业经历，历任诺安基金交易员、中国国际金融有限公司交易员，具有丰富的大资金运作交易经验。现任职公司投资部，为公司投资决策委员会委员。
罗薇	基金经理	2016 年 5 月 4 日	-	4	澳洲新南威尔士大学会计学硕士，北京大学理学学士，具有四年医药/传媒等行业研究经验，2012 年加入红塔红土基金研究部，

					现任职于公司投资部，为公司投资决策委员会委员。
林睿	基金经理	2017年3月2日	-	6	美国范德堡大学经济学专业硕士，北京师范大学电子、经济双学士。近6年证券从业经历，历任中国证券登记结算公司北京分公司信息服务部经理助理、深圳市新智达投资管理有限公司资产管理部经理，2015年加入红塔红土基金研究部，现任职于公司投资部，为公司投资决策委员会委员。

注：1、证券从业年限的计算标准：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；

2、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规，以及《红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规及基金合同等规定，未从事内幕交易、操纵市场等违法、违规行为，未开展有损于基金份额持有人利益的关联交易，整体运作合法合规。

#### 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，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《红塔红土基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等在研究分析、投资决策、交易执行等各业务环节严格控制，公平对待旗下所有投资组合。

报告期内，基金管理人管理的各投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益

率以及不同时间窗内（同日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价格未发现异常差异，各投资组合间不存在违背公平交易原则的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了《红塔红土基金管理有限公司异常交易监控管理办法》，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合外，同一投资组合禁止同日反向交易，不同投资组合之间严格限制同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，需经严格审批并留痕备查。

报告期内，本基金与基金管理人管理的其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%，本基金未发生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

2017 年上半年，伴随商品价格持续修复，工业企业利润延续了 2016 年以来的上涨态势，A 股市场在年初 2 个月表现出较好的活力；随着商品价格陆续显现顶部的迹象，A 股市场的反弹动能也开始出现下滑，3 月指数呈反复震荡。4 月雄安新区概念将市场情绪再次推高，然而随后周期短期见顶、工业企业利润回落带来的基本面变化，与监管强化和资金面收紧的短期因素相叠加，市场情绪溃散式收缩，资金开始向防御性板块聚集，5 月 A 股市场处在向下的估值修复中。伴随着产业资本增持等积极信号的出现，在政策再平衡的累积效应以及流动性边际改善的预期下，市场于 6 月展开了反弹攻势。2017 年上半年，A 股市场在结构上主要呈现出 3 个特点：价值板块表现好于成长板块、大盘股表现好于小盘股、通胀低敏感板块表现好于通胀受益板块。

红塔红土优质成长基金在 2017 年上半年采取积极的股票管理操作，通过量化选股模型，以稳定业绩增长能力为主要选股因子进行标的筛选；并在市场调整过程中寻找超跌反弹机会，通过仓位控制积累收益、回避调整，并通过参与网下新股申购，获得增强收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末红塔红土优质成长 A 基金份额净值为 0.9805 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.54%，同期业绩比较基准收益率为 5.53%；截至本报告期末红塔红土优质成长 C 基金份额净值为 0.9768 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.75%，同期业绩比较基准收益率为 5.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度宏观经济与一季度持平，从商品经济数据看 4-5 月的工业增加值 6.5%，较一季度小幅回落，虽在 6 月份有所反弹至 7.6%，但需求的扩张并不明显，我们仍然维持经济反弹高点在一季度末二季度初，后续经济又将回到缓慢下行探底阶段的判断。上半年，全国固定资产投资同比增长 8.6%，呈现小幅下行趋势，消费增速和进出口数据平稳。物价不论 CPI 还是 PPI 均相对平稳，上行压力不大。

在二季度经济冲高回落的背景下，债券市场的收益率水平走势也大体相同，只是有所滞后。由于金融政策一般滞后于经济数据，在一季度经济数据较好的背景下，二季度初，金融政策进一步收紧，去杠杆的压力引发了债券市场较大幅度的调整，调整同时对股票市场也有所传导，股票市场同步下跌。而后随着经济数据拐点的出现，监管的力度也略有放松，债券市场开始反弹。

而股票在二季度仍然是震荡行情，市场分化进一步加剧，沪深 300 指数上涨 6.1%，而创业板指数下跌 4.68%。整体市场仍然偏重于绩优蓝筹，市场的走势与结构与我们一季度的判断一致。对于三季度，虽然经济背景较二季度可能更弱一点，我们对于股票市场却更为乐观一些，虽然大格局仍然是震荡行情，但三季度可能走出一两个月的持续反弹行情，上涨的动力可能更多的来自监管政策的缓和和市场估值的修复。从结构上看，我们仍然聚焦于企业的业绩，着力寻找行业景气度高，企业业绩好，且估值合理的股票。主题方面我们关注雄安新区的建设进度以及新能源汽车产业链，2017 年是乘用车电动化的元年，预计相关的产业链将在未来有较好的发展前景。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

根据中国证监会的相关规定，本公司针对停牌股票、债券不活跃市场报价等投资品种启用特殊估值流程，由基金估值小组确定相应证券的估值方法。

估值小组成员包括公司领导、运营部门、法律、监察稽核部、研究部等相关人员。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理参与公司启用特殊估值的流程，发表相关意见和建议，与运营部门、公司领导、研究部相关人员共同商定估值原则和政策。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

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

本基金管理人与中证指数有限公司签署服务协议，由其提供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）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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

## § 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

本报告期内，广州农村商业银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由红塔红土基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。



## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,940,205.37	1,162,400.71
结算备付金		1,274,152.78	281,361.51
存出保证金		118,038.92	43,399.34
交易性金融资产	6.4.7.2	251,278,745.80	9,260,335.80
其中：股票投资		131,237,271.80	7,497,085.00
基金投资		-	-
债券投资		120,041,474.00	1,763,250.80
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	2,279,135.75	11,915.06
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		259,890,278.62	10,759,412.42
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		48,699,526.95	-
应付证券清算款		293,850.59	-
应付赎回款		4,911.91	-
应付管理人报酬		135,175.49	11,700.26
应付托管费		33,793.87	2,925.09
应付销售服务费		134.31	136.10
应付交易费用	6.4.7.7	604,492.39	31,705.49

应交税费		-	-
应付利息		18,208.57	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	123,978.50	50,000.00
负债合计		49,914,072.58	96,466.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	214,155,189.07	10,817,390.54
未分配利润	6.4.7.10	-4,178,983.03	-154,445.06
所有者权益合计		209,976,206.04	10,662,945.48
负债和所有者权益总计		259,890,278.62	10,759,412.42

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值人民币 0.9805 元，A 类基金份额 213,473,373.46 份；C 类基金份额净值人民币 0.9768 元，C 类基金份额 681,815.61 份。

## 6.2 利润表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		2,779,388.30	-1,722,475.78
1.利息收入		2,301,047.21	57,342.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	69,007.47	10,174.10
债券利息收入		2,092,806.22	27,951.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		139,233.52	19,216.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-9,677,637.92	-1,488,397.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,970,424.57	-1,549,158.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	62,199.26	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
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	1,230,587.39	60,760.71
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,661,980.27	-291,469.86
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	493,998.74	49.02
<b>减：二、费用</b>		3,402,107.23	284,681.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	846,114.24	76,992.72
2. 托管费	6.4.10.2.2	211,528.55	19,248.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	808.13	881.00
4. 交易费用	6.4.7.19	1,683,166.81	105,470.56
5. 利息支出		517,917.17	-
其中：卖出回购金融资产支出		517,917.17	-
6. 其他费用	6.4.7.20	142,572.33	82,089.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-622,718.93	-2,007,157.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-622,718.93	-2,007,157.33

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	10,817,390.54	-154,445.06	10,662,945.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-622,718.93	-622,718.93
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）	203,337,798.53	-3,401,819.04	199,935,979.49
其中：1.基金申购款	336,041,714.07	-5,090,157.96	330,951,556.11
2.基金赎回款	-132,703,915.54	1,688,338.92	-131,015,576.62
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)	214,155,189.07	-4,178,983.03	209,976,206.04
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	21,155,544.13	970,316.20	22,125,860.33
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	-2,007,157.33	-2,007,157.33
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)	-177,530.55	7,614.51	-169,916.04
其中：1.基金申购款	71,570.42	-4,418.31	67,152.11
2.基金赎回款	-249,100.97	12,032.82	-237,068.15
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)	20,978,013.58	-1,029,226.62	19,948,786.96

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：

\_\_\_\_\_ 刘辉

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 刘辉

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 李志朋

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1467号《关于核准红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人红塔红土基金管理有限公司(以下简称“红塔红土基金公司”)向社会公开发行募集。本基金的首次发售募集的有效认购资金扣除认购费后的净认购金额为人民币 20,979,594.13 元,折合 20,979,594.13 份基金份额

额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 530.52 元，折合 530.52 份基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币 20,980,124.65 元，折合 20,980,124.65 份基金份额。其中 A 类基金首次发售募集的有效认购资金为人民币 20,165,621.38 元，折合 20,165,621.38 份基金份额；C 类基金首次发售募集的有效认购资金为人民币 814,503.27 元，折合 814,503.27 份基金份额。本基金合同于 2015 年 8 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为红塔红土基金公司，注册登记机构为红塔红土基金公司，基金托管人为广州农村商业银行股份有限公司（以下简称“广州农村商业银行”）。

本基金的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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，债券等固定收益资产占基金资产的比例不低于 5%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资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×55%+中债总指数（财富）×45%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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主要包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

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、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为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；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券和衍生工具等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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的



金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.25% 年费率逐日计提；

(4) 其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金收益分配应遵循下列原则：

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配采用现金或红利再投资方式，投资人可选择获取现金红利，投资人可选择获取现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认分红方式为现金红利；

(3) 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；

(4) 在符合上述基金收益分配的前提下，本基金每年收益分配至多六次，每次基金收益分配比例不得低于可供分配利润的 30%；

(5) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(6) 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**

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无需说明的会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期无需要说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

#### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### (2) 营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，免征营业税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称资管产品运营业务)，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得

适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### (3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	4,940,205.37
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	4,940,205.37
-----	--------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	121,290,655.03	131,237,271.80	9,946,616.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	959,968.86	958,474.00
	银行间市场	119,566,041.64	119,083,000.00
	合计	120,526,010.50	120,041,474.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	241,816,665.53	251,278,745.80	9,462,080.27

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金于本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	428.55
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	573.40
应收债券利息	2,278,080.70
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	53.10
合计	2,279,135.75

注：“其他”为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	597,459.36
银行间市场应付交易费用	7,033.03
合计	604,492.39

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6.17
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	99,177.14
合计	123,978.50

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

红塔红土优质成长 A		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,167,386.83	10,167,386.83
本期申购	335,755,698.64	335,755,698.64
本期赎回(以“-”号填列)	-132,449,712.01	-132,449,712.01
- 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	213,473,373.46	213,473,373.46

金额单位：人民币元

红塔红土优质成长 C		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	650,003.71	650,003.71
本期申购	286,015.43	286,015.43
本期赎回(以“-”号填列)	-254,203.53	-254,203.53
- 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	681,815.61	681,815.61

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**

单位：人民币元

红塔红土优质成长 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-116,326.76	-27,866.31	-144,193.07
本期利润	-10,250,451.92	9,632,724.18	-617,727.74
本期基金份额交易产生的变动数	-2,403,737.25	-997,537.33	-3,401,274.58
其中：基金申购款	-4,106,322.35	-978,714.78	-5,085,037.13
基金赎回款	1,702,585.10	-18,822.55	1,683,762.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,770,515.93	8,607,320.54	-4,163,195.39

单位：人民币元

红塔红土优质成长 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,427.83	-1,824.16	-10,251.99
本期利润	-34,247.28	29,256.09	-4,991.19
本期基金份额交易产生的变动数	-466.91	-77.55	-544.46
其中：基金申购款	-2,879.46	-2,241.37	-5,120.83

基金赎回款	2,412.55	2,163.82	4,576.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-43,142.02	27,354.38	-15,787.64

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	22,779.71
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	34,444.44
结算备付金利息收入	10,994.37
其他	788.95
合计	69,007.47

注：“其他存款利息收入”为协议存款利息收入，“其他”为申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	570,266,923.21
减：卖出股票成本总额	581,237,347.78
买卖股票差价收入	-10,970,424.57

#### 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 2017年1月1日至2017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	62,199.26
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	62,199.26



### 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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,826,055.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,138,445.54
减：应收利息总额	625,410.75
买卖债券差价收入	62,199.26

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,230,587.39
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,230,587.39

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	9,661,980.27
——股票投资	10,141,923.17
——债券投资	-479,942.90
——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	9,661,980.27

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	493,998.74
合计	493,998.74

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,681,416.81
银行间市场交易费用	1,750.00
合计	1,683,166.81

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	99,177.14
债券帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	142,572.33

注：“其他”为上交所账户查询费。

### 6.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除在 6.4.6 税项中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
红塔红土基金公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构、发起人
广州农村商业银行	基金托管人、基金销售机构
红塔证券（“红塔证券”）	基金管理人的股东
深圳市红塔资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
红塔证券	143,241,457.40	11.35%	26,288,124.65	37.37%

**6.4.10.1.2 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	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 成交总额的比例
红塔证券	912,565.85	41.46%	-	-

注：本基金上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
红塔证券	156,500,000.00	74.74%	133,400,000.00	100.00%

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金于本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
红塔证券	133,400.64	13.35%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
红塔证券	24,482.18	37.39%	9,977.65	28.62%

**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 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	846,114.24	76,992.72
其中：支付销售机构的客户维护费	417.76	198.10

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	211,528.55	19,248.21
----------------	------------	-----------

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C	合计
红塔红土基金公司	-	735.41	735.41
合计	-	735.41	735.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C	合计
红塔红土基金公司	-	814.93	814.93
合计	-	814.93	814.93

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%。基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

### 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：本基金于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**

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	10,000,100.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,100.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.6700%	-

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	红塔红土优质成长 A	红塔红土优质成长 C
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）持有的基金份额	10,000,100.00	-
期初持有的基金份额	10,000,100.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,100.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	47.6700%	-

注：1、基金管理人持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付；

2、根据《红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，发起资金认购本基金的金额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

2015 年 8 月 6 日（基金合同生效日），红塔红土基金公司运用自有资金作为发起资金认购的本基金份额为 10,000,100.00 份，占本基金发起时份额总量的 47.66%。

**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**

份额单位：份

红塔红土优质成长 A
------------

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
深圳市红塔资产管理有限公司	-	-	100.00	0.0000%

注：1、其他关联方持有本基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、本期末及上年度期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金 C 类基金份额。

#### 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
广州农村商业银行	4,940,205.37	22,779.71	6,851,109.36	8,619.91

注：本基金本期的活期银行存款由基金托管人广州农村商业银行保管，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：本基金于本期及上年度可比期间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

注：无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注



002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月3日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601919	中远海控	2017年5月17日	重大事项	5.35	2017年7月26日	5.89	520,000	2,774,665.00	2,782,000.00	-
002642	荣之联	2017年4月10日	重大事项	25.06	2017年7月7日	22.54	25,900	645,119.00	649,054.00	-
300486	东杰智能	2017年1月25日	重大事项	22.63	2017年8月9日	20.38	18,000	475,226.97	407,340.00	-

#### 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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 48,699,526.95 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
1382023	13 陕交建 MTN1	2017年7月5日	101.25	100,000	10,125,000.00

1382075	13 皖投 MTN1	2017 年 7 月 5 日	100.59	100,000	10,059,000.00
101364002	13 豫水利 MTN002	2017 年 7 月 6 日	102.94	100,000	10,294,000.00
101463015	14 粤建工 MTN001	2017 年 7 月 6 日	100.78	100,000	10,078,000.00
111698206	16 包商银行 CD052	2017 年 7 月 6 日	96.67	100,000	9,667,000.00
合计				500,000	50,223,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、金融工程小组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合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调金融工程小组及其他各部门完成运作风险管理，并进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，并且通过分散化投资以降低信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，

因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	58,298,000.00	-
合计	58,298,000.00	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为债券期限小于等于一年的政策性金融债及银行同业存单。

3、债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	30,319,000.00	905,484.00
AAA 以下	31,424,474.00	857,766.80
未评级	-	-
合计	61,743,474.00	1,763,250.80

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、债券投资以净价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难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相关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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，或可在银行间同业市场交易，因此除批注 6.4.12 中所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，其余均能及时变现。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。

### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：-

### 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、债券投资及买入返售金融资产等，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。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,940,205.37	-	-	-	-	-	4,940,205.37
结算备付金	1,274,152.78	-	-	-	-	-	1,274,152.78
存出保证金	118,038.92	-	-	-	-	-	118,038.92
交易性金融资产	-	-	108,904,570.00	11,136,904.00	-	131,237,271.80	251,278,745.80

应收利息	-	-	-	-	-	2,279,135.75	2,279,135.75
资产总计	6,332,397.07	-	108,904,570.00	11,136,904.00	-	133,516,407.55	259,890,278.62
负债							
卖出回购金融资产款	48,699,526.95	-	-	-	-	-	48,699,526.95
应付证券清算款	-	-	-	-	-	293,850.59	293,850.59
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,911.91	4,911.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	135,175.49	135,175.49
应付托管费	-	-	-	-	-	33,793.87	33,793.87
应付销售服务费	-	-	-	-	-	134.31	134.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	604,492.39	604,492.39
应付利息	-	-	-	-	-	18,208.57	18,208.57
其他负债	-	-	-	-	-	123,978.50	123,978.50
负债总计	48,699,526.95	-	-	-	-	1,214,545.63	49,914,072.58
利率敏感度缺口	-42,367,129.88	-	108,904,570.00	11,136,904.00	-	不适用	不适用
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,162,400.71	-	-	-	-	-	1,162,400.71
结算备付金	281,361.51	-	-	-	-	-	281,361.51
存出保证金	43,399.34	-	-	-	-	-	43,399.34
交易性金融资产	-	-	-	1,763,250.80	-	7,497,085.00	9,260,335.80
应收利息	-	-	-	-	-	11,915.06	11,915.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,487,161.56	-	-	1,763,250.80	-	7,509,000.06	10,759,412.42
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,700.26	11,700.26
应付托管费	-	-	-	-	-	2,925.09	2,925.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	136.10	136.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	31,705.49	31,705.49
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	96,466.94	96,466.94
利率敏感度缺口	1,487,161.56	-	-	1,763,250.80	-	不适用	不适用

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	利率上升 25 个基点	-167,209.38	-4,404.45

	利率下降 25 个基准点	167,767.91	4,424.12
--	--------------	------------	----------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有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。

##### 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	131,237,271.80	62.50	7,497,085.00	70.31
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	120,041,474.00	57.17	1,763,250.80	16.54
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	251,278,745.80	119.67	9,260,335.80	86.85

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。下表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。		
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（2017 年 6 月 30 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 本基金业绩比较基准上升 5%	13,047,354.21	745,023.49
2. 本基金业绩比较基准下降 5%	-13,047,354.21	-745,023.49	

注：本基金业绩比较基准=沪深 300 指数×55%+中债总指数（财富）×45%。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：-

#### 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）承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### （2）其他事项

##### （a）公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### （i）各层次金融工具公允价值

于 2017 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划分为第一层次的余额为人民币 127,275,194.70 元，划分为第二层次的余额为人民币 124,003,551.10 元，无划分为第三层次余额。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资产中划分为第一层次的余额为人民币 7,173,085.00 元，划分为第二层次的余额为人民币 2,087,250.80 元，无划分为第三层次余额。

##### （ii）公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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或第三层次。

##### （iii）第三层次公允价值本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

##### （b）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

### 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	131,237,271.80	50.50
	其中：股票	131,237,271.80	50.50
2	固定收益投资	120,041,474.00	46.19
	其中：债券	120,041,474.00	46.19
	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	6,214,358.15	2.39
7	其他各项资产	2,397,174.67	0.92
8	合计	259,890,278.62	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,876,050.00	1.37
C	制造业	66,030,341.78	31.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,825,792.40	3.73
E	建筑业	2,204,164.00	1.05
F	批发和零售业	3,321,200.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	12,350,032.00	5.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	656,693.62	0.31
J	金融业	15,909,648.00	7.58
K	房地产业	5,652,000.00	2.69
L	租赁和商务服务业	2,990,520.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	-	-



N	水利、环境和公共设施管理业	2,701,800.00	1.29
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	8,719,030.00	4.15
S	综合	-	-
	合计	131,237,271.80	62.50

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未通过沪港通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000895	双汇发展	160,000	3,800,000.00	1.81
2	000022	深赤湾A	125,000	3,718,750.00	1.77
3	601318	中国平安	73,300	3,636,413.00	1.73
4	000338	潍柴动力	267,000	3,524,400.00	1.68
5	000402	金融街	300,000	3,516,000.00	1.67
6	601607	上海医药	115,000	3,321,200.00	1.58
7	300003	乐普医疗	147,000	3,250,170.00	1.55
8	601398	工商银行	618,500	3,247,125.00	1.55
9	000661	长春高新	25,100	3,240,661.00	1.54
10	600887	伊利股份	150,000	3,238,500.00	1.54
11	002563	森马服饰	380,000	3,222,400.00	1.53
12	002008	大族激光	92,000	3,186,880.00	1.52
13	000581	威孚高科	123,000	3,185,700.00	1.52
14	601211	国泰君安	154,000	3,158,540.00	1.50
15	002739	万达电影	61,000	3,109,170.00	1.48
16	600276	恒瑞医药	61,200	3,096,108.00	1.47
17	600004	白云机场	166,700	3,077,282.00	1.47
18	002821	凯莱英	41,812	3,051,021.64	1.45
19	600056	中国医药	117,000	3,036,150.00	1.45
20	600038	中直股份	65,700	3,007,089.00	1.43
21	600900	长江电力	194,980	2,998,792.40	1.43

22	600030	中信证券	176,000	2,995,520.00	1.43
23	600138	中青旅	142,000	2,990,520.00	1.42
24	600562	国睿科技	107,944	2,972,777.76	1.42
25	300144	宋城演艺	140,000	2,921,800.00	1.39
26	600028	中国石化	485,000	2,876,050.00	1.37
27	601939	建设银行	467,000	2,872,050.00	1.37
28	002389	南洋科技	136,000	2,864,160.00	1.36
29	603160	汇顶科技	28,500	2,858,550.00	1.36
30	000601	韶能股份	400,000	2,852,000.00	1.36
31	600196	复星医药	92,000	2,851,080.00	1.36
32	300408	三环集团	133,000	2,791,670.00	1.33
33	002202	金风科技	180,000	2,784,600.00	1.33
34	601919	中远海控	520,000	2,782,000.00	1.32
35	000828	东莞控股	231,000	2,772,000.00	1.32
36	600054	黄山旅游	158,000	2,701,800.00	1.29
37	002343	慈文传媒	71,000	2,688,060.00	1.28
38	002003	伟星股份	254,800	2,662,660.00	1.27
39	000651	格力电器	59,500	2,449,615.00	1.17
40	600068	葛洲坝	196,100	2,204,164.00	1.05
41	600498	烽火通信	86,000	2,180,100.00	1.04
42	001979	招商蛇口	100,000	2,136,000.00	1.02
43	000418	小天鹅A	42,700	1,997,933.00	0.95
44	600886	国投电力	250,000	1,975,000.00	0.94
45	002642	荣之联	25,900	649,054.00	0.31
46	300486	东杰智能	18,000	407,340.00	0.19
47	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
48	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
49	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
50	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
51	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
52	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
53	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
54	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
55	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
56	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
57	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
58	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
59	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
60	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01

61	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
62	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
63	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
64	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601677	明泰铝业	4,434,371.60	41.59
2	000429	粤高速 A	4,257,433.02	39.93
3	600519	贵州茅台	4,129,215.71	38.72
4	000402	金融街	3,978,288.54	37.31
5	600562	国睿科技	3,959,217.62	37.13
6	000895	双汇发展	3,457,363.60	32.42
7	600068	葛洲坝	3,382,976.00	31.73
8	002563	森马服饰	3,268,286.00	30.65
9	600038	中直股份	3,264,320.15	30.61
10	600019	宝钢股份	3,237,222.00	30.36
11	002739	万达电影	3,222,847.68	30.22
12	600028	中国石化	3,203,597.37	30.04
13	601398	工商银行	3,163,264.00	29.67
14	000601	韶能股份	3,047,348.00	28.58
15	002415	海康威视	2,978,502.24	27.93
16	600708	光明地产	2,946,537.65	27.63
17	601318	中国平安	2,913,416.00	27.32
18	603986	兆易创新	2,903,138.00	27.23
19	002008	大族激光	2,892,710.23	27.13
20	600276	恒瑞医药	2,847,344.00	26.70
21	300144	宋城演艺	2,846,611.90	26.70
22	300408	三环集团	2,841,672.00	26.65
23	000338	潍柴动力	2,827,893.14	26.52
24	600036	招商银行	2,822,716.00	26.47
25	600054	黄山旅游	2,813,672.44	26.39
26	002821	凯莱英	2,812,815.40	26.38

27	300003	乐普医疗	2,811,354.98	26.37
28	000022	深赤湾 A	2,810,807.00	26.36
29	600056	中国医药	2,806,778.59	26.32
30	600138	中青旅	2,802,746.97	26.28
31	600071	凤凰光学	2,801,709.05	26.28
32	600064	南京高科	2,798,991.91	26.25
33	300182	捷成股份	2,797,517.55	26.24
34	600196	复星医药	2,792,572.00	26.19
35	000963	华东医药	2,787,630.56	26.14
36	601939	建设银行	2,778,650.00	26.06
37	000581	威孚高科	2,778,400.02	26.06
38	002343	慈文传媒	2,775,908.00	26.03
39	601919	中远海控	2,774,665.00	26.02
40	601211	国泰君安	2,773,776.00	26.01
41	600660	福耀玻璃	2,756,838.98	25.85
42	002003	伟星股份	2,756,443.00	25.85
43	000028	国药一致	2,743,992.98	25.73
44	600030	中信证券	2,737,554.00	25.67
45	000661	长春高新	2,731,946.00	25.62
46	600004	白云机场	2,731,421.84	25.62
47	000900	现代投资	2,725,276.00	25.56
48	603160	汇顶科技	2,723,587.00	25.54
49	600900	长江电力	2,723,310.24	25.54
50	600452	涪陵电力	2,718,207.64	25.49
51	002202	金风科技	2,714,843.00	25.46
52	002389	南洋科技	2,714,209.00	25.45
53	000828	东莞控股	2,697,787.00	25.30
54	600711	盛屯矿业	2,682,020.00	25.15
55	601607	上海医药	2,677,826.00	25.11
56	600887	伊利股份	2,616,201.54	24.54
57	000726	鲁泰 A	2,572,119.00	24.12
58	000543	皖能电力	2,484,266.98	23.30
59	600335	国机汽车	2,404,656.71	22.55
60	002540	亚太科技	2,340,737.72	21.95
61	000650	仁和药业	2,312,216.50	21.68
62	600073	上海梅林	2,290,072.99	21.48

63	000915	山大华特	2,275,503.00	21.34
64	000796	凯撒旅游	2,275,035.50	21.34
65	002014	永新股份	2,264,573.80	21.24
66	600162	香江控股	2,259,610.00	21.19
67	600961	株冶集团	2,219,553.61	20.82
68	002083	孚日股份	2,217,304.83	20.79
69	600531	豫光金铅	2,201,239.00	20.64
70	600027	华电国际	2,196,591.00	20.60
71	600757	长江传媒	2,178,822.81	20.43
72	000960	锡业股份	2,151,621.11	20.18
73	600782	新钢股份	2,148,094.00	20.15
74	600823	世茂股份	2,117,246.50	19.86
75	000701	厦门信达	2,102,718.58	19.72
76	600461	洪城水业	2,073,014.89	19.44
77	600498	烽火通信	2,067,549.50	19.39
78	600845	宝信软件	2,051,353.50	19.24
79	000708	大冶特钢	2,051,183.25	19.24
80	600269	赣粤高速	2,036,989.65	19.10
81	600894	广日股份	2,012,428.43	18.87
82	600289	亿阳信通	2,008,597.00	18.84
83	600886	国投电力	1,989,500.00	18.66
84	000651	格力电器	1,985,469.03	18.62
85	000418	小天鹅A	1,984,318.00	18.61
86	001979	招商蛇口	1,980,154.00	18.57
87	601313	江南嘉捷	1,979,287.96	18.56
88	600750	江中药业	1,972,286.40	18.50
89	600697	欧亚集团	1,970,433.45	18.48
90	000718	苏宁环球	1,970,263.75	18.48
91	300017	网宿科技	1,957,100.00	18.35
92	600677	航天通信	1,936,129.00	18.16
93	600668	尖峰集团	1,935,077.98	18.15
94	600206	有研新材	1,931,674.69	18.12
95	002133	广宇集团	1,923,290.00	18.04
96	600278	东方创业	1,865,611.39	17.50
97	600969	郴电国际	1,855,140.00	17.40
98	002157	正邦科技	1,854,353.00	17.39

99	002100	天康生物	1,847,609.68	17.33
100	600093	易见股份	1,844,968.00	17.30
101	600033	福建高速	1,842,881.00	17.28
102	601688	华泰证券	1,826,485.00	17.13
103	600026	中远海能	1,823,595.00	17.10
104	601231	环旭电子	1,803,725.32	16.92
105	600835	上海机电	1,795,090.62	16.83
106	300357	我武生物	1,794,051.65	16.83
107	601058	赛轮金宇	1,789,863.00	16.79
108	600508	上海能源	1,743,847.81	16.35
109	600966	博汇纸业	1,741,425.90	16.33
110	600051	宁波联合	1,724,145.51	16.17
111	603128	华贸物流	1,689,805.10	15.85
112	601518	吉林高速	1,658,597.00	15.55
113	600455	博通股份	1,657,081.00	15.54
114	600350	山东高速	1,650,024.97	15.47
115	000667	美好置业	1,640,469.19	15.38
116	002026	山东威达	1,630,105.49	15.29
117	600810	神马股份	1,608,401.26	15.08
118	600271	航天信息	1,598,253.88	14.99
119	600797	浙大网新	1,588,660.00	14.90
120	600100	同方股份	1,586,892.00	14.88
121	600713	南京医药	1,576,084.59	14.78
122	600975	新五丰	1,553,669.00	14.57
123	300074	华平股份	1,550,236.76	14.54
124	601636	旗滨集团	1,544,367.00	14.48
125	600325	华发股份	1,532,545.00	14.37
126	600483	福能股份	1,526,218.52	14.31
127	600185	格力地产	1,519,963.93	14.25
128	002441	众业达	1,514,174.32	14.20
129	000665	湖北广电	1,507,815.24	14.14
130	002270	华明装备	1,506,822.00	14.13
131	002309	中利集团	1,505,781.16	14.12
132	300219	鸿利智汇	1,504,669.00	14.11
133	000021	深科技	1,495,421.76	14.02
134	300240	飞力达	1,458,035.81	13.67

135	600808	马钢股份	1,457,732.00	13.67
136	002088	鲁阳节能	1,449,640.56	13.60
137	002237	恒邦股份	1,446,219.00	13.56
138	002171	楚江新材	1,431,009.12	13.42
139	600067	冠城大通	1,422,055.00	13.34
140	002641	永高股份	1,420,332.80	13.32
141	600980	北矿科技	1,405,328.50	13.18
142	002440	闰土股份	1,404,927.62	13.18
143	000876	新希望	1,404,632.00	13.17
144	300048	合康新能	1,382,030.60	12.96
145	002135	东南网架	1,377,806.04	12.92
146	600891	秋林集团	1,376,993.99	12.91
147	002728	特一药业	1,376,899.13	12.91
148	600510	黑牡丹	1,368,923.30	12.84
149	000936	华西股份	1,363,403.82	12.79
150	600176	中国巨石	1,360,133.00	12.76
151	600126	杭钢股份	1,350,190.00	12.66
152	601678	滨化股份	1,348,946.04	12.65
153	000883	湖北能源	1,346,715.00	12.63
154	000006	深振业A	1,343,502.18	12.60
155	300282	汇冠股份	1,340,840.00	12.57
156	600104	上汽集团	1,335,305.21	12.52
157	600548	深高速	1,327,619.00	12.45
158	600795	国电电力	1,325,105.00	12.43
159	600748	上实发展	1,322,699.00	12.40
160	600741	华域汽车	1,321,279.00	12.39
161	002267	陕天然气	1,321,212.00	12.39
162	601088	中国神华	1,320,269.00	12.38
163	600377	宁沪高速	1,316,594.50	12.35
164	600642	申能股份	1,316,257.00	12.34
165	000679	大连友谊	1,315,579.00	12.34
166	600252	中恒集团	1,314,975.00	12.33
167	000531	穗恒运A	1,314,606.00	12.33
168	000732	泰禾集团	1,310,384.53	12.29
169	300067	安诺其	1,308,741.47	12.27
170	000069	华侨城A	1,307,951.00	12.27

171	002627	宜昌交运	1,307,385.29	12.26
172	000719	大地传媒	1,306,612.29	12.25
173	600499	科达洁能	1,305,817.01	12.25
174	600439	瑞贝卡	1,305,641.99	12.24
175	600177	雅戈尔	1,305,159.22	12.24
176	600035	楚天高速	1,305,110.81	12.24
177	002626	金达威	1,304,879.48	12.24
178	002394	联发股份	1,304,509.76	12.23
179	600688	上海石化	1,303,496.10	12.22
180	600665	天地源	1,301,571.00	12.21
181	600606	绿地控股	1,298,164.00	12.17
182	600811	东方集团	1,296,699.00	12.16
183	300039	上海凯宝	1,295,531.16	12.15
184	002281	光迅科技	1,294,341.00	12.14
185	002541	鸿路钢构	1,294,067.23	12.14
186	600292	远达环保	1,292,698.84	12.12
187	000030	富奥股份	1,291,906.80	12.12
188	000951	中国重汽	1,291,095.08	12.11
189	000552	靖远煤电	1,289,355.00	12.09
190	300108	双龙股份	1,288,259.96	12.08
191	000761	本钢板材	1,286,456.00	12.06
192	000919	金陵药业	1,285,817.79	12.06
193	002737	葵花药业	1,285,097.00	12.05
194	002534	杭锅股份	1,284,850.00	12.05
195	600346	恒力股份	1,282,381.00	12.03
196	002727	一心堂	1,281,560.64	12.02
197	600039	四川路桥	1,281,316.29	12.02
198	000703	恒逸石化	1,280,722.56	12.01
199	600210	紫江企业	1,280,457.00	12.01
200	600585	海螺水泥	1,279,987.00	12.00
201	600467	好当家	1,279,274.72	12.00
202	601222	林洋能源	1,277,255.16	11.98
203	002001	新和成	1,277,063.23	11.98
204	002092	中泰化学	1,275,783.00	11.96
205	600236	桂冠电力	1,275,020.00	11.96
206	002033	丽江旅游	1,274,796.91	11.96



207	002118	紫鑫药业	1,274,074.14	11.95
208	300269	联建光电	1,273,156.32	11.94
209	300274	阳光电源	1,272,890.20	11.94
210	600637	东方明珠	1,272,414.66	11.93
211	600846	同济科技	1,271,422.21	11.92
212	000686	东北证券	1,271,062.91	11.92
213	000898	鞍钢股份	1,270,065.00	11.91
214	300339	润和软件	1,269,272.00	11.90
215	000059	华锦股份	1,268,666.00	11.90
216	600704	物产中大	1,265,693.00	11.87
217	601339	百隆东方	1,264,728.91	11.86
218	000990	诚志股份	1,264,063.50	11.85
219	600308	华泰股份	1,259,076.72	11.81
220	000751	锌业股份	1,258,274.00	11.80
221	300026	红日药业	1,257,064.00	11.79
222	000420	吉林化纤	1,257,019.00	11.79
223	300206	理邦仪器	1,256,023.25	11.78
224	600805	悦达投资	1,253,712.99	11.76
225	000521	美菱电器	1,253,048.96	11.75
226	601579	会稽山	1,251,799.28	11.74
227	600170	上海建工	1,250,448.00	11.73
228	002452	长高集团	1,249,592.94	11.72
229	600011	华能国际	1,249,164.00	11.71
230	600567	山鹰纸业	1,247,509.00	11.70
231	002037	久联发展	1,244,519.60	11.67
232	002515	金字火腿	1,243,131.50	11.66
233	601233	桐昆股份	1,237,073.41	11.60
234	000587	金洲慈航	1,236,174.00	11.59
235	002462	嘉事堂	1,235,502.96	11.59
236	600129	太极集团	1,234,328.58	11.58
237	002344	海宁皮城	1,233,999.00	11.57
238	300326	凯利泰	1,233,566.67	11.57
239	000055	方大集团	1,230,753.50	11.54
240	600513	联环药业	1,230,660.24	11.54
241	600960	渤海活塞	1,228,540.81	11.52
242	000813	德展健康	1,227,805.00	11.51

243	002147	新光圆成	1,225,758.00	11.50
244	603168	莎普爱思	1,221,407.15	11.45
245	600216	浙江医药	1,205,221.49	11.30
246	000978	桂林旅游	1,204,935.00	11.30
247	002087	新野纺织	1,200,546.00	11.26
248	601699	潞安环能	1,199,025.54	11.24
249	002063	远光软件	1,189,360.00	11.15
250	300139	晓程科技	1,169,387.57	10.97
251	600990	四创电子	1,163,848.65	10.91
252	603939	益丰药房	1,133,081.26	10.63
253	603883	老百姓	1,130,939.89	10.61
254	002352	顺丰控股	1,124,031.96	10.54
255	600057	象屿股份	1,120,808.63	10.51
256	002013	中航机电	1,112,885.00	10.44
257	002582	好想你	1,097,328.00	10.29
258	603609	禾丰牧业	1,086,755.00	10.19
259	600557	康缘药业	1,083,653.80	10.16
260	603123	翠微股份	1,074,000.00	10.07
261	002412	汉森制药	1,071,061.00	10.04
262	600976	健民集团	1,063,655.97	9.98
263	600435	北方导航	1,056,009.00	9.90
264	300031	宝通科技	1,055,374.00	9.90
265	000513	丽珠集团	1,051,965.00	9.87
266	000637	茂化实华	1,050,643.23	9.85
267	600261	阳光照明	1,050,056.00	9.85
268	002369	卓翼科技	1,049,141.70	9.84
269	600285	羚锐制药	1,047,061.00	9.82
270	002313	日海通讯	1,044,443.00	9.80
271	600998	九州通	1,043,811.23	9.79
272	002203	海亮股份	1,040,508.44	9.76
273	002017	东信和平	1,039,063.00	9.74
274	600768	宁波富邦	1,038,881.00	9.74
275	000795	英洛华	1,036,939.90	9.72
276	600327	大东方	1,033,810.73	9.70
277	000790	泰合健康	1,031,367.00	9.67
278	002194	武汉凡谷	1,030,969.00	9.67

279	600829	人民同泰	1,030,054.96	9.66
280	300236	上海新阳	1,027,002.37	9.63
281	000705	浙江震元	1,020,079.38	9.57
282	600529	山东药玻	1,017,241.00	9.54
283	002187	广百股份	1,010,605.16	9.48
284	600288	大恒科技	1,004,388.00	9.42
285	600694	大商股份	1,004,163.00	9.42
286	300389	艾比森	1,002,649.91	9.40
287	002057	中钢天源	1,000,779.85	9.39
288	600623	华谊集团	998,239.00	9.36
289	002165	红宝丽	990,922.00	9.29
290	300076	GQY 视讯	990,473.00	9.29
291	000597	东北制药	985,534.94	9.24
292	002182	云海金属	982,683.10	9.22
293	002470	金正大	981,253.00	9.20
294	000422	湖北宜化	981,176.00	9.20
295	002618	丹邦科技	977,660.00	9.17
296	600597	光明乳业	972,868.63	9.12
297	000404	华意压缩	971,720.43	9.11
298	600077	宋都股份	969,519.00	9.09
299	000989	九芝堂	969,375.00	9.09
300	600418	江淮汽车	969,024.00	9.09
301	002550	千红制药	966,908.00	9.07
302	000421	南京公用	964,436.35	9.04
303	600847	*ST 万里	963,065.00	9.03
304	300238	冠昊生物	962,467.66	9.03
305	300049	福瑞股份	959,967.76	9.00
306	300424	航新科技	957,693.06	8.98
307	603366	日出东方	954,263.00	8.95
308	002467	二六三	949,323.72	8.90
309	000523	广州浪奇	945,808.00	8.87
310	002045	国光电器	944,423.00	8.86
311	300207	欣旺达	939,013.00	8.81
312	300012	华测检测	933,504.00	8.75
313	600237	铜峰电子	919,413.11	8.62
314	000411	英特集团	917,053.00	8.60

315	600062	华润双鹤	914,780.00	8.58
316	600203	福日电子	913,730.09	8.57
317	002566	益盛药业	913,296.00	8.57
318	002294	信立泰	913,056.00	8.56
319	603989	艾华集团	908,553.00	8.52
320	000702	正虹科技	905,354.00	8.49
321	600983	惠而浦	904,139.44	8.48
322	000823	超声电子	902,322.82	8.46
323	300227	光韵达	899,411.00	8.43
324	600594	益佰制药	899,351.00	8.43
325	000733	振华科技	891,844.35	8.36
326	002314	南山控股	883,525.55	8.29
327	002056	横店东磁	879,316.38	8.25
328	300398	飞凯材料	867,813.66	8.14
329	600315	上海家化	862,209.00	8.09
330	600850	华东电脑	860,115.11	8.07
331	002712	思美传媒	858,607.00	8.05
332	600458	时代新材	856,427.46	8.03
333	600020	中原高速	848,408.00	7.96
334	002533	金杯电工	846,806.61	7.94
335	002557	洽洽食品	842,208.95	7.90
336	002731	萃华珠宝	842,100.04	7.90
337	002196	方正电机	839,724.17	7.88
338	002574	明牌珠宝	839,171.00	7.87
339	600426	华鲁恒升	834,706.80	7.83
340	000966	长源电力	834,677.00	7.83
341	600561	江西长运	833,227.53	7.81
342	600366	宁波韵升	830,829.00	7.79
343	002719	麦趣尔	828,750.70	7.77
344	600683	京投发展	828,513.68	7.77
345	601218	吉鑫科技	828,422.56	7.77
346	000908	景峰医药	828,344.93	7.77
347	300303	聚飞光电	826,704.00	7.75
348	603100	川仪股份	826,573.00	7.75
349	002130	沃尔核材	825,393.34	7.74
350	002184	海得控制	825,365.84	7.74

351	600517	置信电气	825,113.00	7.74
352	600889	南京化纤	821,452.50	7.70
353	002124	天邦股份	814,136.00	7.64
354	600248	延长化建	812,063.38	7.62
355	300226	上海钢联	803,620.76	7.54
356	600207	安彩高科	803,307.00	7.53
357	000759	中百集团	801,273.76	7.51
358	000785	武汉中商	790,157.80	7.41
359	600287	江苏舜天	786,780.00	7.38
360	603223	恒通股份	783,304.04	7.35
361	600052	浙江广厦	781,003.06	7.32
362	300365	恒华科技	778,355.34	7.30
363	600058	五矿发展	774,220.00	7.26
364	600729	重庆百货	765,280.25	7.18
365	000555	神州信息	764,157.57	7.17
366	600997	开滦股份	763,960.00	7.16
367	300264	佳创视讯	760,847.86	7.14
368	300286	安科瑞	760,119.08	7.13
369	600305	恒顺醋业	758,552.79	7.11
370	000681	视觉中国	755,499.22	7.09
371	300231	银信科技	754,363.00	7.07
372	300378	鼎捷软件	750,091.44	7.03
373	603020	爱普股份	749,688.98	7.03
374	600537	亿晶光电	749,138.00	7.03
375	002216	三全食品	748,233.00	7.02
376	600718	东软集团	742,095.29	6.96
377	002528	英飞拓	740,939.00	6.95
378	600973	宝胜股份	738,184.00	6.92
379	600268	国电南自	736,710.52	6.91
380	002350	北京科锐	736,095.69	6.90
381	600875	东方电气	731,434.24	6.86
382	000668	荣丰控股	730,962.01	6.86
383	600898	国美通讯	730,321.00	6.85
384	300396	迪瑞医疗	726,500.39	6.81
385	600723	首商股份	724,174.00	6.79
386	600476	湘邮科技	720,598.00	6.76

387	002366	台海核电	719,412.73	6.75
388	002471	中超控股	719,040.00	6.74
389	000899	赣能股份	716,558.00	6.72
390	000043	中航地产	715,286.00	6.71
391	000926	福星股份	713,150.00	6.69
392	000036	华联控股	711,579.00	6.67
393	002082	栋梁新材	708,323.00	6.64
394	000958	东方能源	704,173.00	6.60
395	600235	民丰特纸	696,930.74	6.54
396	600323	瀚蓝环境	685,704.79	6.43
397	002236	大华股份	684,489.00	6.42
398	002396	星网锐捷	684,465.48	6.42
399	002615	哈尔斯	684,454.98	6.42
400	601139	深圳燃气	681,834.00	6.39
401	600769	祥龙电业	679,968.00	6.38
402	002419	天虹股份	673,769.00	6.32
403	600356	恒丰纸业	673,591.97	6.32
404	002225	濮耐股份	671,528.00	6.30
405	601126	四方股份	670,421.00	6.29
406	002231	奥维通信	667,055.00	6.26
407	600396	金山股份	665,256.00	6.24
408	600470	六国化工	663,550.85	6.22
409	600780	通宝能源	658,944.77	6.18
410	600600	青岛啤酒	657,954.00	6.17
411	603003	龙宇燃油	657,847.00	6.17
412	000977	浪潮信息	656,938.58	6.16
413	002577	雷柏科技	654,001.00	6.13
414	600295	鄂尔多斯	653,493.00	6.13
415	000488	晨鸣纸业	649,200.00	6.09
416	000905	厦门港务	648,080.00	6.08
417	002642	荣之联	645,119.00	6.05
418	600141	兴发集团	636,912.00	5.97
419	600496	精工钢构	633,632.83	5.94
420	000619	海螺型材	629,053.00	5.90
421	300163	先锋新材	624,112.00	5.85
422	601928	凤凰传媒	620,755.00	5.82

423	300119	瑞普生物	619,008.73	5.81
424	000755	*ST 三维	617,127.00	5.79
425	300105	龙源技术	616,366.60	5.78
426	002692	睿康股份	615,537.00	5.77
427	600238	海南椰岛	614,865.00	5.77
428	000848	承德露露	611,779.00	5.74
429	002058	威尔泰	609,364.00	5.71
430	000031	中粮地产	606,326.65	5.69
431	002567	唐人神	600,518.20	5.63
432	002387	黑牛食品	597,735.00	5.61
433	600684	珠江实业	597,706.00	5.61
434	600742	一汽富维	597,442.00	5.60
435	600076	康欣新材	597,132.49	5.60
436	600970	中材国际	590,240.49	5.54
437	300477	合纵科技	586,148.36	5.50
438	000625	长安汽车	585,144.00	5.49
439	300312	邦讯技术	583,385.00	5.47
440	601886	江河集团	583,143.00	5.47
441	600862	中航高科	580,726.00	5.45
442	002417	三元达	580,355.00	5.44
443	000851	高鸿股份	580,106.00	5.44
444	603012	创力集团	577,820.00	5.42
445	603618	杭电股份	575,691.00	5.40
446	300165	天瑞仪器	574,948.12	5.39
447	002706	良信电器	574,319.00	5.39
448	300228	富瑞特装	573,528.00	5.38
449	300360	炬华科技	573,402.00	5.38
450	000731	四川美丰	573,187.00	5.38
451	603969	银龙股份	571,626.22	5.36
452	002234	民和股份	571,587.13	5.36
453	002310	东方园林	570,800.00	5.35
454	002733	雄韬股份	569,974.93	5.35
455	300265	通光线缆	569,887.00	5.34
456	600830	香溢融通	568,587.00	5.33
457	000698	沈阳化工	567,882.39	5.33
458	300164	通源石油	565,849.27	5.31

459	000906	浙商中拓	562,063.00	5.27
460	600081	东风科技	560,656.23	5.26
461	300070	碧水源	557,853.71	5.23
462	000957	中通客车	554,979.05	5.20
463	002607	亚夏汽车	552,162.58	5.18
464	002458	益生股份	551,934.00	5.18
465	600060	海信电器	548,993.52	5.15
466	600109	国金证券	548,975.09	5.15
467	000700	模塑科技	548,875.47	5.15
468	600354	敦煌种业	545,097.00	5.11
469	000550	江铃汽车	544,358.00	5.11
470	002548	金新农	543,267.42	5.09
471	600584	长电科技	541,100.00	5.07
472	603167	渤海轮渡	539,930.00	5.06
473	002062	宏润建设	536,530.00	5.03
474	600501	航天晨光	536,452.00	5.03
475	002039	黔源电力	536,263.00	5.03
476	002357	富临运业	535,359.33	5.02
477	000600	建投能源	535,337.88	5.02
478	600612	老凤祥	529,827.00	4.97
479	300262	巴安水务	529,363.00	4.96
480	000655	金岭矿业	526,326.00	4.94
481	603188	亚邦股份	526,085.00	4.93
482	600881	亚泰集团	524,479.00	4.92
483	600075	新疆天业	522,282.00	4.90
484	600831	广电网络	519,166.00	4.87
485	601929	吉视传媒	516,496.00	4.84
486	000639	西王食品	515,084.92	4.83
487	000910	大亚圣象	510,818.51	4.79
488	600189	吉林森工	509,583.00	4.78
489	002671	龙泉股份	504,515.00	4.73
490	000498	山东路桥	504,352.00	4.73
491	600022	山东钢铁	503,986.00	4.73
492	000023	深天地A	498,898.35	4.68
493	601985	中国核电	497,733.00	4.67
494	600509	天富能源	492,638.96	4.62



495	300056	三维丝	491,037.00	4.61
496	000528	柳工	489,500.00	4.59
497	002420	毅昌股份	489,331.00	4.59
498	601890	亚星锚链	489,248.00	4.59
499	002511	中顺洁柔	488,160.00	4.58
500	002048	宁波华翔	487,599.00	4.57
501	600653	申华控股	486,610.00	4.56
502	601390	中国中铁	486,442.00	4.56
503	600121	*ST 郑煤	485,954.00	4.56
504	603519	立霸股份	484,193.00	4.54
505	000921	海信科龙	484,081.00	4.54
506	002713	东易日盛	483,378.83	4.53
507	300298	三诺生物	483,146.19	4.53
508	002680	长生生物	477,435.00	4.48
509	300486	东杰智能	475,226.97	4.46
510	600971	恒源煤电	469,560.00	4.40
511	000529	广弘控股	465,583.00	4.37
512	000628	高新发展	464,474.00	4.36
513	002532	新界泵业	462,191.36	4.33
514	000632	三木集团	461,370.00	4.33
515	603818	曲美家居	456,771.00	4.28
516	300214	日科化学	456,558.00	4.28
517	600626	申达股份	448,596.00	4.21
518	600231	凌钢股份	445,432.00	4.18
519	002482	广田集团	439,616.00	4.12
520	603001	奥康国际	438,017.62	4.11
521	002015	霞客环保	436,629.00	4.09
522	600689	上海三毛	436,611.00	4.09
523	600389	江山股份	436,338.34	4.09
524	002763	汇洁股份	434,495.92	4.07
525	600630	龙头股份	433,886.00	4.07
526	300210	森远股份	433,501.39	4.07
527	600691	阳煤化工	433,092.00	4.06
528	002002	鸿达兴业	433,083.00	4.06
529	002060	粤水电	432,975.15	4.06
530	000782	美达股份	432,713.00	4.06

531	002324	普利特	430,821.62	4.04
532	002722	金轮股份	428,836.77	4.02
533	002372	伟星新材	428,400.50	4.02
534	601208	东材科技	427,615.00	4.01
535	002302	西部建设	427,191.00	4.01
536	002588	史丹利	427,181.00	4.01
537	603518	维格娜丝	425,834.00	3.99
538	600502	安徽水利	425,457.00	3.99
539	002556	辉隆股份	423,778.00	3.97
540	600096	云天化	423,227.00	3.97
541	600986	科达股份	423,204.00	3.97
542	002510	天汽模	422,792.81	3.97
543	002172	澳洋科技	422,725.00	3.96
544	002150	通润装备	422,234.66	3.96
545	601668	中国建筑	422,135.00	3.96
546	300354	东华测试	421,248.00	3.95
547	002154	报喜鸟	420,731.00	3.95
548	002555	三七互娱	417,535.00	3.92
549	002248	*ST 东数	417,016.00	3.91
550	002559	亚威股份	415,876.00	3.90
551	000570	苏常柴 A	415,210.00	3.89
552	000920	南方汇通	414,673.99	3.89
553	601566	九牧王	413,216.00	3.88
554	002543	万和电气	411,801.00	3.86
555	603600	永艺股份	410,784.75	3.85
556	600337	美克家居	410,406.00	3.85
557	601098	中南传媒	403,948.81	3.79
558	002159	三特索道	399,583.00	3.75
559	603008	喜临门	389,883.00	3.66
560	603611	诺力股份	383,951.00	3.60
561	600761	安徽合力	382,974.00	3.59
562	600992	贵绳股份	381,876.00	3.58
563	000530	大冷股份	380,170.00	3.57
564	600860	*ST 京城	378,894.00	3.55
565	600569	安阳钢铁	378,784.00	3.55
566	300341	麦迪电气	377,615.76	3.54

567	601177	杭齿前进	375,906.00	3.53
568	603899	晨光文具	375,128.22	3.52
569	000723	美锦能源	374,161.00	3.51
570	002705	新宝股份	372,882.00	3.50
571	002209	达意隆	371,619.97	3.49
572	002301	齐心集团	364,374.32	3.42
573	000415	渤海金控	364,136.00	3.41
574	600882	广泽股份	358,581.93	3.36
575	002403	爱仕达	354,355.00	3.32
576	000780	*ST 平能	351,142.00	3.29
577	002043	兔宝宝	349,814.98	3.28
578	002517	恺英网络	310,220.12	2.91
579	002327	富安娜	309,043.70	2.90
580	002612	朗姿股份	307,114.17	2.88
581	002293	罗莱生活	306,775.00	2.88
582	002640	跨境通	296,735.00	2.78
583	002721	金一文化	288,635.00	2.71
584	601601	中国太保	282,104.00	2.65
585	601336	新华保险	270,353.00	2.54
586	000721	西安饮食	247,996.00	2.33
587	603199	九华旅游	235,673.37	2.21
588	002186	全聚德	235,068.50	2.20

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超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	600519	贵州茅台	4,405,751.60	41.32
2	000429	粤高速 A	4,361,069.80	40.90
3	601677	明泰铝业	4,292,089.43	40.25
4	600036	招商银行	3,347,245.85	31.39
5	002415	海康威视	3,272,432.62	30.69
6	600019	宝钢股份	3,169,868.70	29.73
7	000963	华东医药	2,905,262.00	27.25
8	300182	捷成股份	2,903,501.00	27.23

9	600708	光明地产	2,846,398.00	26.69
10	600660	福耀玻璃	2,810,491.00	26.36
11	600711	盛屯矿业	2,777,148.74	26.04
12	000028	国药一致	2,775,165.29	26.03
13	000900	现代投资	2,696,326.74	25.29
14	600064	南京高科	2,665,925.90	25.00
15	603986	兆易创新	2,616,236.00	24.54
16	600452	涪陵电力	2,597,117.00	24.36
17	000726	鲁泰A	2,544,479.20	23.86
18	600071	凤凰光学	2,474,924.45	23.21
19	300017	网宿科技	2,470,966.36	23.17
20	000915	山大华特	2,423,475.00	22.73
21	002540	亚太科技	2,365,671.50	22.19
22	000543	皖能电力	2,364,846.18	22.18
23	600335	国机汽车	2,329,189.21	21.84
24	600269	赣粤高速	2,275,327.50	21.34
25	600073	上海梅林	2,252,390.47	21.12
26	002083	孚日股份	2,241,925.40	21.03
27	000650	仁和药业	2,203,309.17	20.66
28	600961	株冶集团	2,200,663.06	20.64
29	002014	永新股份	2,172,186.16	20.37
30	600531	豫光金铅	2,156,894.82	20.23
31	600750	江中药业	2,134,285.00	20.02
32	600027	华电国际	2,126,861.20	19.95
33	600162	香江控股	2,126,420.50	19.94
34	600757	长江传媒	2,119,989.52	19.88
35	600782	新钢股份	2,114,047.77	19.83
36	000960	锡业股份	2,111,542.96	19.80
37	000796	凯撒旅游	2,099,420.51	19.69
38	600668	尖峰集团	2,022,651.67	18.97
39	000708	大冶特钢	2,002,808.14	18.78
40	000701	厦门信达	1,999,616.28	18.75
41	600068	葛洲坝	1,999,400.00	18.75
42	600823	世茂股份	1,992,541.00	18.69
43	600845	宝信软件	1,969,083.14	18.47
44	600461	洪城水业	1,961,537.80	18.40
45	600894	广日股份	1,939,611.95	18.19
46	600697	欧亚集团	1,937,115.92	18.17

47	600206	有研新材	1,923,198.67	18.04
48	600289	亿阳信通	1,916,549.54	17.97
49	601313	江南嘉捷	1,909,089.50	17.90
50	600677	航天通信	1,909,054.10	17.90
51	000718	苏宁环球	1,896,279.30	17.78
52	600093	易见股份	1,860,705.34	17.45
53	600033	福建高速	1,858,826.00	17.43
54	002100	天康生物	1,809,566.00	16.97
55	600835	上海机电	1,805,355.96	16.93
56	601688	华泰证券	1,787,822.91	16.77
57	600278	东方创业	1,775,179.70	16.65
58	601231	环旭电子	1,771,506.30	16.61
59	600969	郴电国际	1,770,062.00	16.60
60	601058	赛轮金宇	1,767,842.70	16.58
61	300357	我武生物	1,752,563.15	16.44
62	002133	广宇集团	1,738,672.24	16.31
63	600026	中远海能	1,736,254.33	16.28
64	600508	上海能源	1,683,233.07	15.79
65	600100	同方股份	1,653,289.75	15.51
66	600966	博汇纸业	1,653,179.00	15.50
67	002627	宜昌交运	1,646,806.31	15.44
68	002157	正邦科技	1,638,396.20	15.37
69	600797	浙大网新	1,621,910.00	15.21
70	600271	航天信息	1,619,860.70	15.19
71	600455	博通股份	1,619,155.68	15.18
72	002026	山东威达	1,574,311.81	14.76
73	603128	华贸物流	1,573,407.00	14.76
74	600325	华发股份	1,552,269.00	14.56
75	300074	华平股份	1,537,079.56	14.42
76	002728	特一药业	1,534,056.99	14.39
77	600051	宁波联合	1,528,220.51	14.33
78	600185	格力地产	1,504,681.80	14.11
79	600483	福能股份	1,500,698.73	14.07
80	600350	山东高速	1,499,110.34	14.06
81	300219	鸿利智汇	1,495,691.92	14.03
82	601518	吉林高速	1,493,496.00	14.01
83	000667	美好置业	1,474,824.00	13.83
84	603123	翠微股份	1,463,007.00	13.72

85	600980	北矿科技	1,454,558.00	13.64
86	600810	神马股份	1,448,767.44	13.59
87	002237	恒邦股份	1,445,516.10	13.56
88	300240	飞力达	1,443,882.30	13.54
89	000665	湖北广电	1,427,588.63	13.39
90	002440	闰土股份	1,423,071.26	13.35
91	600713	南京医药	1,417,677.20	13.30
92	601636	旗滨集团	1,409,028.60	13.21
93	000021	深科技	1,401,455.40	13.14
94	002309	中利集团	1,396,043.06	13.09
95	000978	桂林旅游	1,396,000.30	13.09
96	002441	众业达	1,395,888.12	13.09
97	000876	新希望	1,376,778.00	12.91
98	600176	中国巨石	1,375,426.60	12.90
99	002270	华明装备	1,370,933.96	12.86
100	002171	楚江新材	1,367,380.79	12.82
101	300206	理邦仪器	1,365,677.38	12.81
102	600126	杭钢股份	1,364,484.00	12.80
103	600808	马钢股份	1,362,072.00	12.77
104	002737	葵花药业	1,361,099.58	12.76
105	002088	鲁阳节能	1,359,012.06	12.75
106	601088	中国神华	1,349,584.90	12.66
107	002281	光迅科技	1,347,896.12	12.64
108	600067	冠城大通	1,343,166.00	12.60
109	002462	嘉事堂	1,322,267.00	12.40
110	600177	雅戈尔	1,318,889.93	12.37
111	002727	一心堂	1,313,482.80	12.32
112	002641	永高股份	1,312,967.50	12.31
113	600035	楚天高速	1,307,005.60	12.26
114	601678	滨化股份	1,306,549.50	12.25
115	600795	国电电力	1,300,135.00	12.19
116	000679	大连友谊	1,299,294.88	12.19
117	002267	陕天然气	1,298,500.83	12.18
118	600637	东方明珠	1,293,187.04	12.13
119	600104	上汽集团	1,291,635.00	12.11
120	600252	中恒集团	1,290,571.87	12.10
121	600704	物产中大	1,288,690.00	12.09
122	600439	瑞贝卡	1,285,021.00	12.05

123	600606	绿地控股	1,282,849.61	12.03
124	600499	科达洁能	1,281,024.14	12.01
125	000883	湖北能源	1,279,630.90	12.00
126	000990	诚志股份	1,278,875.68	11.99
127	600011	华能国际	1,277,200.13	11.98
128	600567	山鹰纸业	1,274,390.09	11.95
129	600975	新五丰	1,271,956.74	11.93
130	300039	上海凯宝	1,269,353.60	11.90
131	600548	深高速	1,264,355.00	11.86
132	002534	杭锅股份	1,263,474.48	11.85
133	600688	上海石化	1,262,024.29	11.84
134	000919	金陵药业	1,261,289.38	11.83
135	300067	安诺其	1,260,068.80	11.82
136	600642	申能股份	1,258,499.20	11.80
137	601222	林洋能源	1,255,804.00	11.78
138	000719	大地传媒	1,255,242.90	11.77
139	000030	富奥股份	1,255,136.60	11.77
140	000006	深振业 A	1,254,730.82	11.77
141	002626	金达威	1,251,442.11	11.74
142	600748	上实发展	1,248,996.25	11.71
143	300274	阳光电源	1,243,031.00	11.66
144	600741	华域汽车	1,242,542.38	11.65
145	300269	联建光电	1,239,983.43	11.63
146	300108	双龙股份	1,236,255.80	11.59
147	600377	宁沪高速	1,235,946.03	11.59
148	300048	合康新能	1,231,833.20	11.55
149	000069	华侨城 A	1,231,592.70	11.55
150	000059	华锦股份	1,231,496.40	11.55
151	000703	恒逸石化	1,230,980.91	11.54
152	000521	美菱电器	1,224,470.00	11.48
153	600811	东方集团	1,223,110.75	11.47
154	002001	新 和 成	1,219,007.30	11.43
155	600805	悦达投资	1,217,797.98	11.42
156	300326	凯利泰	1,217,111.76	11.41
157	300339	润和软件	1,214,530.00	11.39
158	600292	远达环保	1,207,261.16	11.32
159	600210	紫江企业	1,205,622.80	11.31
160	600170	上海建工	1,204,462.00	11.30

161	601339	百隆东方	1,202,042.74	11.27
162	600039	四川路桥	1,201,401.60	11.27
163	000751	锌业股份	1,199,847.60	11.25
164	300026	红日药业	1,198,640.60	11.24
165	002135	东南网架	1,198,374.50	11.24
166	002045	国光电器	1,197,461.00	11.23
167	000732	泰禾集团	1,195,796.14	11.21
168	002118	紫鑫药业	1,195,264.00	11.21
169	000898	鞍钢股份	1,193,916.80	11.20
170	002063	远光软件	1,192,806.00	11.19
171	000587	金洲慈航	1,191,092.77	11.17
172	600585	海螺水泥	1,190,585.22	11.17
173	002092	中泰化学	1,189,635.20	11.16
174	603168	莎普爱思	1,189,260.72	11.15
175	601233	桐昆股份	1,189,155.40	11.15
176	000531	穗恒运 A	1,188,896.90	11.15
177	002147	新光圆成	1,187,681.00	11.14
178	000552	靖远煤电	1,185,961.00	11.12
179	600846	同济科技	1,179,242.63	11.06
180	300282	汇冠股份	1,179,160.50	11.06
181	000936	华西股份	1,174,830.23	11.02
182	000761	本钢板材	1,173,307.94	11.00
183	000420	吉林化纤	1,169,842.00	10.97
184	600513	联环药业	1,169,834.00	10.97
185	002013	中航机电	1,165,916.62	10.93
186	000951	中国重汽	1,162,926.86	10.91
187	601579	会稽山	1,162,567.99	10.90
188	002033	丽江旅游	1,161,820.80	10.90
189	600665	天地源	1,159,135.00	10.87
190	600510	黑牡丹	1,157,865.57	10.86
191	000813	德展健康	1,157,004.00	10.85
192	600129	太极集团	1,154,653.26	10.83
193	600308	华泰股份	1,153,872.95	10.82
194	002394	联发股份	1,152,758.12	10.81
195	002203	海亮股份	1,150,800.00	10.79
196	600467	好当家	1,147,641.16	10.76
197	002087	新野纺织	1,146,057.16	10.75
198	000055	方大集团	1,144,105.13	10.73



199	600346	恒力股份	1,140,294.60	10.69
200	300236	上海新阳	1,138,275.35	10.68
201	002515	金字火腿	1,136,472.80	10.66
202	002541	鸿路钢构	1,135,592.33	10.65
203	002344	海宁皮城	1,132,840.15	10.62
204	300070	碧水源	1,130,016.94	10.60
205	603939	益丰药房	1,128,450.76	10.58
206	600891	秋林集团	1,127,563.50	10.57
207	600557	康缘药业	1,126,246.54	10.56
208	002452	长高集团	1,125,919.80	10.56
209	600435	北方导航	1,124,215.00	10.54
210	000686	东北证券	1,121,519.71	10.52
211	300207	欣旺达	1,121,440.73	10.52
212	601699	潞安环能	1,120,688.95	10.51
213	600960	渤海活塞	1,117,073.13	10.48
214	002037	久联发展	1,116,285.37	10.47
215	600236	桂冠电力	1,112,988.33	10.44
216	002194	武汉凡谷	1,102,522.47	10.34
217	603883	老百姓	1,097,350.20	10.29
218	600057	象屿股份	1,089,909.80	10.22
219	002352	顺丰控股	1,078,083.80	10.11
220	002017	东信和平	1,077,902.57	10.11
221	600562	国睿科技	1,077,593.00	10.11
222	600990	四创电子	1,076,437.00	10.10
223	603609	禾丰牧业	1,074,605.90	10.08
224	000513	丽珠集团	1,068,621.00	10.02
225	300139	晓程科技	1,062,084.70	9.96
226	000488	晨鸣纸业	1,058,565.00	9.93
227	002313	日海通讯	1,057,898.00	9.92
228	600216	浙江医药	1,043,149.77	9.78
229	002310	东方园林	1,036,983.00	9.73
230	600998	九州通	1,034,548.80	9.70
231	002618	丹邦科技	1,018,169.80	9.55
232	002369	卓翼科技	1,010,690.00	9.48
233	002056	横店东磁	1,002,541.86	9.40
234	300031	宝通科技	1,002,016.90	9.40
235	600261	阳光照明	999,901.40	9.38
236	600418	江淮汽车	996,585.00	9.35

237	000823	超声电子	993,819.00	9.32
238	002165	红宝丽	992,256.46	9.31
239	002470	金正大	991,864.00	9.30
240	600288	大恒科技	987,920.10	9.26
241	600529	山东药玻	985,066.53	9.24
242	600327	大东方	983,627.52	9.22
243	002582	好想你	980,869.95	9.20
244	600694	大商股份	978,590.30	9.18
245	000597	东北制药	973,380.00	9.13
246	000637	茂化实华	972,144.34	9.12
247	002187	广百股份	969,510.26	9.09
248	600829	人民同泰	966,373.82	9.06
249	000421	南京公用	964,297.23	9.04
250	002236	大华股份	959,990.35	9.00
251	600285	羚锐制药	957,145.60	8.98
252	600584	长电科技	956,025.00	8.97
253	600597	光明乳业	953,920.40	8.95
254	600976	健民集团	953,090.00	8.94
255	603989	艾华集团	951,864.96	8.93
256	002057	中钢天源	950,459.80	8.91
257	002412	汉森制药	949,520.60	8.90
258	000790	泰合健康	945,449.20	8.87
259	600983	惠而浦	934,219.19	8.76
260	600062	华润双鹤	933,332.00	8.75
261	300424	航新科技	931,245.80	8.73
262	000705	浙江震元	929,382.70	8.72
263	300012	华测检测	926,688.40	8.69
264	600077	宋都股份	925,398.60	8.68
265	000422	湖北宣化	923,982.57	8.67
266	000404	华意压缩	921,889.40	8.65
267	002182	云海金属	919,985.00	8.63
268	002294	信立泰	919,385.00	8.62
269	603366	日出东方	913,551.00	8.57
270	000411	英特集团	913,114.96	8.56
271	000795	英洛华	911,457.80	8.55
272	002467	二六三	910,831.26	8.54
273	002550	千红制药	908,106.00	8.52
274	000523	广州浪奇	907,118.96	8.51

275	300389	艾比森	906,031.97	8.50
276	002314	南山控股	904,876.80	8.49
277	600237	铜峰电子	901,503.86	8.45
278	600623	华谊集团	899,576.40	8.44
279	300049	福瑞股份	898,280.70	8.42
280	600207	安彩高科	894,316.64	8.39
281	600315	上海家化	890,483.80	8.35
282	600020	中原高速	890,305.00	8.35
283	000989	九芝堂	889,374.25	8.34
284	300227	光韵达	885,850.16	8.31
285	002566	益盛药业	883,412.00	8.28
286	300398	飞凯材料	874,128.74	8.20
287	600768	宁波富邦	867,997.90	8.14
288	000702	正虹科技	866,030.90	8.12
289	300303	聚飞光电	864,816.00	8.11
290	000905	厦门港务	861,100.00	8.08
291	600847	*ST 万里	860,394.78	8.07
292	000958	东方能源	859,940.00	8.06
293	002196	方正电机	859,276.88	8.06
294	000681	视觉中国	858,871.49	8.05
295	600517	置信电气	858,327.00	8.05
296	300238	冠昊生物	856,412.60	8.03
297	600594	益佰制药	855,814.90	8.03
298	002719	麦趣尔	848,970.00	7.96
299	002557	洽洽食品	845,984.59	7.93
300	600426	华鲁恒升	844,583.40	7.92
301	600203	福日电子	844,180.00	7.92
302	601218	吉鑫科技	844,170.00	7.92
303	002712	思美传媒	839,499.80	7.87
304	603100	川仪股份	835,887.85	7.84
305	600683	京投发展	826,901.71	7.75
306	600729	重庆百货	826,284.01	7.75
307	600458	时代新材	824,933.20	7.74
308	600850	华东电脑	824,543.20	7.73
309	600889	南京化纤	821,046.30	7.70
310	000402	金融街	816,157.80	7.65
311	300076	GQY 视讯	811,965.70	7.61
312	000966	长源电力	807,585.30	7.57

313	002533	金杯电工	803,989.00	7.54
314	000043	中航地产	802,318.00	7.52
315	002184	海得控制	801,589.38	7.52
316	000733	振华科技	793,673.40	7.44
317	002130	沃尔核材	792,376.84	7.43
318	000908	景峰医药	790,193.00	7.41
319	600287	江苏舜天	788,807.67	7.40
320	600366	宁波韵升	784,687.35	7.36
321	002574	明牌珠宝	782,553.08	7.34
322	600038	中直股份	774,526.40	7.26
323	300226	上海钢联	773,764.18	7.26
324	600295	鄂尔多斯	771,232.50	7.23
325	600305	恒顺醋业	770,241.60	7.22
326	600052	浙江广厦	766,268.25	7.19
327	002731	萃华珠宝	759,150.55	7.12
328	600248	延长化建	754,478.90	7.08
329	000899	赣能股份	753,887.08	7.07
330	002124	天邦股份	748,942.20	7.02
331	600997	开滦股份	748,389.40	7.02
332	601126	四方股份	741,714.20	6.96
333	600875	东方电气	740,717.60	6.95
334	002419	天虹股份	740,426.00	6.94
335	000926	福星股份	731,930.00	6.86
336	000785	武汉中商	731,602.28	6.86
337	002225	濮耐股份	730,806.00	6.85
338	300365	恒华科技	730,636.80	6.85
339	600058	五矿发展	730,483.93	6.85
340	002567	唐人神	723,964.63	6.79
341	600561	江西长运	723,546.10	6.79
342	000759	中百集团	719,955.44	6.75
343	601139	深圳燃气	717,512.46	6.73
344	300264	佳创视讯	717,121.17	6.73
345	600718	东软集团	716,363.00	6.72
346	600268	国电南自	716,154.54	6.72
347	600537	亿晶光电	711,345.00	6.67
348	600600	青岛啤酒	709,944.38	6.66
349	002350	北京科锐	709,713.60	6.66
350	603020	爱普股份	708,354.70	6.64

351	600973	宝胜股份	707,955.40	6.64
352	000036	华联控股	706,945.21	6.63
353	600723	首商股份	704,966.78	6.61
354	002216	三全食品	704,666.60	6.61
355	002528	英飞拓	701,461.25	6.58
356	300231	银信科技	699,169.46	6.56
357	000555	神州信息	694,190.35	6.51
358	002366	台海核电	693,621.36	6.50
359	600141	兴发集团	691,764.00	6.49
360	603223	恒通股份	691,732.50	6.49
361	603003	龙宇燃油	685,109.00	6.43
362	600496	精工钢构	680,191.60	6.38
363	002231	奥维通信	677,428.65	6.35
364	002471	中超控股	676,605.80	6.35
365	600742	一汽富维	676,439.96	6.34
366	600780	通宝能源	673,318.30	6.31
367	600684	珠江实业	672,615.80	6.31
368	002159	三特索道	670,522.40	6.29
369	600769	祥龙电业	668,710.22	6.27
370	300286	安科瑞	666,157.50	6.25
371	600476	湘邮科技	657,786.00	6.17
372	300378	鼎捷软件	652,848.37	6.12
373	300396	迪瑞医疗	652,423.43	6.12
374	000668	荣丰控股	650,186.00	6.10
375	600323	瀚蓝环境	647,872.00	6.08
376	002396	星网锐捷	636,964.00	5.97
377	600898	国美通讯	635,824.60	5.96
378	000977	浪潮信息	633,686.00	5.94
379	002082	栋梁新材	630,302.00	5.91
380	000031	中粮地产	629,171.70	5.90
381	600396	金山股份	628,822.40	5.90
382	600356	恒丰纸业	627,568.60	5.89
383	600235	民丰特纸	626,885.69	5.88
384	600470	六国化工	623,147.20	5.84
385	601928	凤凰传媒	617,057.60	5.79
386	002615	哈尔斯	616,167.20	5.78
387	300312	邦讯技术	615,617.20	5.77
388	002302	西部建设	612,726.76	5.75

389	002058	威尔泰	611,862.82	5.74
390	600970	中材国际	610,287.00	5.72
391	000848	承德露露	609,670.00	5.72
392	002387	黑牛食品	603,859.00	5.66
393	600238	海南椰岛	601,887.00	5.64
394	300265	通光线缆	600,560.92	5.63
395	000957	中通客车	597,419.96	5.60
396	000910	大亚圣象	595,839.00	5.59
397	603969	银龙股份	591,062.21	5.54
398	002577	雷柏科技	590,980.70	5.54
399	600075	新疆天业	590,265.00	5.54
400	600830	香溢融通	585,647.00	5.49
401	000755	*ST 三维	583,086.82	5.47
402	000731	四川美丰	581,452.00	5.45
403	601886	江河集团	579,450.00	5.43
404	000625	长安汽车	576,214.60	5.40
405	603618	杭电股份	575,922.40	5.40
406	000619	海螺型材	571,558.60	5.36
407	000851	高鸿股份	569,766.40	5.34
408	300119	瑞普生物	567,806.32	5.33
409	600060	海信电器	565,575.00	5.30
410	300105	龙源技术	565,001.90	5.30
411	300163	先锋新材	563,752.00	5.29
412	002417	三元达	563,140.99	5.28
413	000921	海信科龙	560,618.20	5.26
414	600109	国金证券	560,616.00	5.26
415	002692	睿康股份	557,280.00	5.23
416	600862	中航高科	556,554.00	5.22
417	600612	老凤祥	556,530.40	5.22
418	002706	良信电器	552,181.07	5.18
419	000698	沈阳化工	550,561.30	5.16
420	300165	天瑞仪器	548,606.13	5.14
421	000700	模塑科技	548,506.00	5.14
422	603167	渤海轮渡	546,981.00	5.13
423	600076	康欣新材	545,592.60	5.12
424	002062	宏润建设	543,995.50	5.10
425	600881	亚泰集团	540,156.40	5.07
426	300164	通源石油	540,039.80	5.06

427	603188	亚邦股份	538,336.00	5.05
428	300228	富瑞特装	537,419.20	5.04
429	300262	巴安水务	537,257.00	5.04
430	600971	恒源煤电	536,164.80	5.03
431	300477	合纵科技	535,262.00	5.02
432	603012	创力集团	533,943.08	5.01
433	000600	建投能源	533,522.10	5.00
434	600081	东风科技	525,829.12	4.93
435	300360	炬华科技	525,765.90	4.93
436	000550	江铃汽车	524,282.20	4.92
437	000906	浙商中拓	524,273.64	4.92
438	002548	金新农	522,997.10	4.90
439	601890	亚星锚链	522,610.00	4.90
440	002039	黔源电力	521,790.95	4.89
441	002733	雄韬股份	521,385.00	4.89
442	000528	柳工	519,763.60	4.87
443	002511	中顺洁柔	519,437.23	4.87
444	601390	中国中铁	507,506.60	4.76
445	002357	富临运业	504,741.00	4.73
446	600022	山东钢铁	501,997.00	4.71
447	600831	广电网络	500,893.00	4.70
448	601929	吉视传媒	500,550.00	4.69
449	601985	中国核电	497,336.00	4.66
450	002607	亚夏汽车	494,697.70	4.64
451	000655	金岭矿业	491,565.60	4.61
452	600501	航天晨光	490,517.32	4.60
453	600354	敦煌种业	489,750.23	4.59
454	002458	益生股份	487,258.20	4.57
455	002146	荣盛发展	486,632.00	4.56
456	603519	立霸股份	485,543.50	4.55
457	601668	中国建筑	484,107.00	4.54
458	002060	粤水电	482,083.00	4.52
459	000498	山东路桥	481,041.80	4.51
460	002671	龙泉股份	480,688.54	4.51
461	002048	宁波华翔	480,560.00	4.51
462	002713	东易日盛	479,300.00	4.50
463	002482	广田集团	476,546.80	4.47
464	000023	深天地A	475,269.00	4.46

465	002234	民和股份	474,019.00	4.45
466	600653	申华控股	470,622.00	4.41
467	600189	吉林森工	469,120.00	4.40
468	002002	鸿达兴业	465,155.00	4.36
469	600509	天富能源	462,395.00	4.34
470	300298	三诺生物	461,974.17	4.33
471	000639	西王食品	460,447.22	4.32
472	600121	*ST 郑煤	458,606.40	4.30
473	000628	高新发展	458,050.00	4.30
474	000632	三木集团	456,803.91	4.28
475	600231	凌钢股份	453,865.50	4.26
476	002543	万和电气	452,956.02	4.25
477	600028	中国石化	450,956.00	4.23
478	300056	三维丝	450,317.00	4.22
479	600337	美克家居	447,163.06	4.19
480	603518	维格娜丝	446,102.44	4.18
481	000529	广弘控股	445,773.00	4.18
482	603001	奥康国际	443,526.99	4.16
483	002510	天汽模	441,452.00	4.14
484	603818	曲美家居	440,721.52	4.13
485	603600	永艺股份	439,878.36	4.13
486	300354	东华测试	439,630.12	4.12
487	600389	江山股份	436,855.38	4.10
488	002559	亚威股份	436,159.00	4.09
489	002722	金轮股份	434,182.00	4.07
490	002015	霞客环保	433,361.05	4.06
491	002555	三七互娱	432,381.50	4.05
492	002680	长生生物	430,103.07	4.03
493	002324	普利特	429,632.17	4.03
494	601566	九牧王	426,862.18	4.00
495	600986	科达股份	426,154.00	4.00
496	600502	安徽水利	425,154.00	3.99
497	600691	阳煤化工	423,776.00	3.97
498	002532	新界泵业	422,956.00	3.97
499	002420	毅昌股份	421,831.34	3.96
500	002372	伟星新材	417,678.40	3.92
501	600626	申达股份	416,225.60	3.90
502	002172	澳洋科技	415,095.92	3.89



503	600630	龙头股份	413,252.00	3.88
504	601208	东材科技	412,550.30	3.87
505	601098	中南传媒	411,613.12	3.86
506	000920	南方汇通	409,495.80	3.84
507	002763	汇洁股份	407,680.00	3.82
508	002588	史丹利	406,796.56	3.82
509	000530	大冷股份	406,554.00	3.81
510	002301	齐心集团	406,544.23	3.81
511	000782	美达股份	406,030.00	3.81
512	002705	新宝股份	405,891.40	3.81
513	000601	韶能股份	405,640.40	3.80
514	002154	报喜鸟	404,335.80	3.79
515	300214	日科化学	403,453.05	3.78
516	600096	云天化	399,503.50	3.75
517	601177	杭齿前进	396,835.00	3.72
518	002556	辉隆股份	396,255.60	3.72
519	600569	安阳钢铁	394,483.60	3.70
520	600689	上海三毛	392,044.30	3.68
521	300210	森远股份	390,340.48	3.66
522	600761	安徽合力	388,050.87	3.64
523	000415	渤海金控	379,955.00	3.56
524	000570	苏常柴A	378,276.20	3.55
525	002209	达意隆	376,178.00	3.53
526	600992	贵绳股份	375,666.00	3.52
527	300341	麦迪电气	373,828.00	3.51
528	603899	晨光文具	368,927.77	3.46
529	603611	诺力股份	363,954.00	3.41
530	603008	喜临门	360,829.00	3.38
531	002150	通润装备	360,356.40	3.38
532	600860	*ST 京城	359,433.00	3.37
533	002563	森马服饰	351,638.00	3.30
534	600882	广泽股份	349,914.00	3.28
535	000723	美锦能源	341,084.00	3.20
536	002403	爱仕达	341,053.80	3.20
537	002043	兔宝宝	339,801.40	3.19
538	000780	*ST 平能	332,588.00	3.12
539	002327	富安娜	292,627.80	2.74
540	002248	*ST 东数	287,478.00	2.70

541	002293	罗莱生活	287,181.30	2.69
542	002721	金一文化	284,873.40	2.67
543	002612	朗姿股份	277,759.00	2.60
544	600048	保利地产	274,920.00	2.58
545	002640	跨境通	269,910.52	2.53
546	601601	中国太保	268,491.50	2.52
547	002517	恺英网络	267,912.60	2.51
548	000721	西安饮食	264,266.00	2.48
549	601336	新华保险	260,629.00	2.44
550	002186	全聚德	240,131.00	2.25
551	603199	九华旅游	236,852.11	2.22
552	002008	大族激光	230,772.95	2.16
553	000965	天保基建	215,424.00	2.02

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	694,835,611.41
卖出股票收入（成交）总额	570,266,923.21

### 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	9,957,000.00	4.74
	其中：政策性金融债	9,957,000.00	4.74
4	企业债券	842,904.00	0.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	60,785,000.00	28.95
7	可转债（可交换债）	115,570.00	0.06
8	同业存单	48,341,000.00	23.02
9	其他	-	-
10	合计	120,041,474.00	57.17

## 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	101364002	13 豫水利 MTN002	100,000	10,294,000.00	4.90
2	1282421	12 湘高速 MTN2	100,000	10,135,000.00	4.83
3	1382023	13 陕交建 MTN1	100,000	10,125,000.00	4.82
4	1282477	12 渝文资 MTN3	100,000	10,094,000.00	4.81
5	101463015	14 粤建工 MTN001	100,000	10,078,000.00	4.80

## 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：本基金报告期内未持有股指期货投资，也无期间损益。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金报告期内未参与股指期货交易。

## 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

注：本基金报告期内未参与国债期货交易。

**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：本基金报告期内未持有国债期货投资，也无期间损益。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

注：本基金报告期内未参与国债期货交易。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

本报告期末，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

**7.12.2**

基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	118,038.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,279,135.75
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,397,174.67

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本报告期内，本基金所持可转换债券均不处于转股期。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字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

### 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
红塔红土优质成长A	119	1,793,893.89	213,202,642.49	99.87%	270,730.97	0.13%
红塔红土优质成长C	96	7,102.25	0.00	-	681,815.61	100.00%
合计	215	996,070.65	213,202,642.49	99.56%	952,546.58	0.44%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）；

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

### 8.2 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	红塔红土优质成长A	100,962.66	0.0473%
	红塔红土优质成长C	614,502.90	90.1274%
	合计	715,465.56	0.3341%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	红塔红土优质成长 A	0~10
	红塔红土优质成长 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	红塔红土优质成长 A	0~10
	红塔红土优质成长 C	-
	合计	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,100.00	4.67	10,000,100.00	4.67	3 年
基金管理人高级管理人员	608,474.50	0.28	-	-	-
基金经理等人员	99,236.35	0.05	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	7,754.71	0.00	-	-	-
合计	10,715,565.56	5.00	10,000,100.00	4.67	3 年

注：1、上述份额总数为扣除认购费用并包含利息结转份额后的总份额数；

2、本基金发起式资金提供方仅为基金管理人，基金管理人基金经理、其他从业人员认购的基金份额不属于发起份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	红塔红土优质成 长 A	红塔红土优质成 长 C
基金合同生效日（2015 年 8 月 6 日）基金份 额总额	20,165,621.38	814,503.27
本报告期期初基金份额总额	10,167,386.83	650,003.71
本报告期基金总申购份额	335,755,698.64	286,015.43
减：本报告期基金总赎回份额	132,449,712.01	254,203.53
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	213,473,373.46	681,815.61

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

公司 2017 年第 2 次办公会审议通过，同意赵耀不再担任红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，增聘林睿担任红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。公司已于 2017 年 1 月 24 日在基金业协会注册登记林睿为红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理，并于 2017 年 3 月 2 日进行了公告。

基金托管人的专门托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内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

本基金本报告期基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	股票交易	应支付该券商的佣金



	交易单元数量	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	备注
中金公司	2	882,917,856.93	69.94%	645,679.10	64.62%	新增
华创证券	1	229,216,550.15	18.16%	213,469.93	21.37%	-
红塔证券	1	143,241,457.40	11.35%	133,400.64	13.35%	-
长城证券	2	7,084,040.39	0.56%	6,597.44	0.66%	-
国海证券	2	-	-	-	-	新增

注：本基金管理人在租用证券机构交易单元上符合中国证监会的有关规定。本基金管理人将证券经营机构的注册资本、研究水平、财务状况、经营状况、经营行为以及通讯交易条件作为基金专用交易单元的选择标准，由研究部、投资部及交易部对券商进行考评并提出交易单元租用及更换方案。

### 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
中金公司	1,288,246.30	58.54%	50,900,000.00	24.31%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	912,565.85	41.46%	156,500,000.00	74.74%	-	-
长城证券	-	-	2,000,000.00	0.96%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内本基金未发生交易所权证交易。

2、本报告期内本基金未发生交易所基金交易。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年1月17日
2	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金2016年第4季度报告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017年1月20日

3	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 2 月 20 日
4	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 3 月 2 日
5	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金恢复大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 3 月 9 日
6	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书及摘要(2017 年 1 号)	证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 3 月 21 日
7	关于红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 3 月 28 日
8	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金 2016 年度报告及摘要	证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 3 月 28 日
9	红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 4 月 24 日
10	红塔红土基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2017 年 5 月 17 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	71,008,216.68	132,194,325.81	-	203,202,542.49	94.89%
	2	20170103-20170324	-	131,872,489.35	131,872,489.35	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情形，可能出现大额赎回导致基金净值波动的风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产导致投资者赎回申请延期办理的风险。敬请投资者留意。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、红塔红土优质成长灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：广东省深圳市南山区侨香路 4068 号智慧广场 A 栋 801

基金托管人的办公场所：广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

### 12.3 查阅方式

投资者可通过基金管理人网站，或在营业期间到基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

客服热线：4001-666-916（免长途话费）

公司网址：[www.htamc.com.cn](http://www.htamc.com.cn)

红塔红土基金管理有限公司

2017 年 8 月 25 日