

# 创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

## 2017 年半年度报告

2017 年 06 月 30 日

基金管理人:创金合信基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2017 年 08 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 06 月 30 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
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	94
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	94
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	94
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	94
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	94
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
7.12 投资组合报告附注	95
§8 基金份额持有人信息	96
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	96
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	96

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情况 .....	96
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	97
§9 开放式基金份额变动 .....	98
§10 重大事件揭示 .....	98
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	98
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 .....	98
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	98
10.4 基金投资策略的改变 .....	98
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	98
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 .....	98
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	99
10.8 其他重大事件 .....	100
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	102
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 .....	102
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	103
§12 备查文件目录 .....	103
12.1 备查文件目录 .....	103
12.2 存放地点 .....	103
12.3 查阅方式 .....	103

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	创金合信中证1000增强	
基金主代码	003646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月22日	
基金管理人	创金合信基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	211,823,366.71份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	创金合信中证1000增强A	创金合信中证1000增强C
下属分级基金的交易代码	003646	003647
报告期末下属分级基金的份额总额	205,208,427.65份	6,614,939.06份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	本基金为指数增强型股票基金，采取定量方法进行组合管理，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%、年跟踪误差不超过7.5%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+一年期人民币定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益

	水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。	本基金为股票型基金，理论上其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

### 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	创金合信基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁绍锋
	联系电话	0755-23838908
	电子邮箱	liangshaofeng@cjhxfund.com
客户服务电话	400-868-0666	95599
传真	0755-25832571	010-68121816
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	北京市东城区建国门内大街 6 9 号
办公地址	深圳市福田区福华一路 1 15 号投行大厦 15 层	北京市西城区复兴门内大街 2 8 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518000	100031
法定代表人	刘学民	周慕冰

### 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
----------------	------

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cjhxfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	创金合信基金管理有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦15层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年01月01日-2017年06月30日)	
	创金合信中证1000增强 A	创金合信中证1000增强 C
本期已实现收益	-11,802,858.89	-339,151.86
本期利润	-12,352,723.09	-242,893.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0633	-0.0435
本期加权平均净值利润率	-6.56%	-4.51%
本期基金份额净值增长率	-4.40%	-4.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	-12,498,568.89	-406,845.59
期末可供分配基金份额利润	-0.0609	-0.0615
期末基金资产净值	193,969,101.78	6,248,640.02
期末基金份额净值	0.9452	0.9446
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-5.48%	-5.54%

注：1. 上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. 期末可供分配利润是采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

创金合信中证1000增强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	4.81%	1.01%	3.34%	1.03%	1.47%	-0.02%
过去三个月	-4.64%	1.06%	-9.94%	1.10%	5.30%	-0.04%
过去六个月	-4.40%	0.97%	-11.44%	1.01%	7.04%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-5.48%	0.95%	-12.60%	0.98%	7.12%	-0.03%

创金合信中证1000增强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	4.80%	1.01%	3.34%	1.03%	1.46%	-0.02%
过去三个月	-4.65%	1.06%	-9.94%	1.10%	5.29%	-0.04%
过去六个月	-4.45%	0.97%	-11.44%	1.01%	6.99%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-5.54%	0.95%	-12.60%	0.98%	7.06%	-0.03%

#### 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



创金合信中证1000增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年12月22日-2017年06月30日)



创金合信中证1000增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年12月22日-2017年06月30日)



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

创金合信基金管理有限公司于2014年7月2日获得中国证监会批复，2014年7月9日正式注册设立，注册地为深圳市。公司由第一创业证券股份有限公司、深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）共同出资设立。公司注册资本1.7亿元人民币，股东出资情况为：第一创业证券股份有限公司出资11,900万元，占公司注册资本的70%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）出资5,100万元，占公司注册资本的30%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

报告期内，本公司共发行4只公募基金。截至2017年6月30日，本公司共管理27只公募基金，其中混合型产品9只、指数型产品3只、债券型产品10只、股票型产品3只、货币型产品1只、保本型产品1只；管理的公募基金规模约153.51亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
庞世恩	基金经理	2016-12-22	-	6年	庞世恩先生，中国国籍，中国人民大学理学硕士。2011年7月加入泰康资产管理有限责任公司，历任金融工程助理研究员、金融工程研究经理、金融工程研究高级经理、金融工程研究总监、执行投资经理。2015年9月加入创金合信基金管理有限公司，现任基金经理。
程志田	基金经理、量化投资部总监	2016-12-22	-	10年	程志田先生，中国国籍，金融学硕士，2006年7月加入长江证券股份有限公司任高级研究经理。2009年7月加入国海证券股份有限公司任金融工程总监。2011年7月加入摩根士丹利华鑫基金管理有限公司，于2011年11月15日至2013年4月1

					5日担任大摩深证300基金的基金经理。2013年9月加入泰康资产管理有限责任公司任量化投资总监。2015年5月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化投资部总监、基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------------------------------------------------------------

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算的起止时间按照从事证券行业开始时间计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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（2011年修订）》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下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%的交易共18次，为基金在调仓时点因选股模型和其他基金选股模型产生分歧而发生的反向交易，未对当天的股票价格产生冲击。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2017年上半年，我们严格依据量化模型进行投资，并严格进行风险管理。一方面，我们按照量化选股模型进行股票组合构建；另一方面，仓位管理上，我们按照量化择时模型进行操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类净值增长率为-4.40%，C类净值增长率为-4.45%，同期业绩比较基准收益率为-11.44%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在过去的半年里，经济数据超预期。2季度GDP及6月份工业、投资、消费、进出口增长均超预期，工业生产延续强势，收入回升支撑消费，企业盈利改善。目前CPI水平较低，因为通胀引发货币政策收紧的可能性很小。经历了过去两年市场调整，当前股市估值略偏低；增量资金进场意愿不明显，市场依然存在较多的结构性机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人在风险控制办公会下设估值小组，组长由公司总经理担任，成员由基金运营部、研究部、监察稽核部、综合部人员组成，实行一人一票制，可邀请专业人士列席，但不具表决权，基金运营部是估值小组的日常办事机构。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

#### 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

本基金为发起式基金，不适用本项说明。

### § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-创金合信基金管理有限公司2017年1月1日至2017年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，创金合信基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有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：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06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	8,347,583.67	518,397.12
结算备付金		2,382,382.16	-
存出保证金		87,712.97	-
交易性金融资产	6.4.7.2	190,113,650.32	9,503,201.00
其中：股票投资		190,113,650.32	9,503,201.00

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,761,010.62	7,258.41
应收利息	6.4.7.5	2,785.29	1,073.26
应收股利		-	-
应收申购款		5,545.90	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		203,700,670.93	10,029,929.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年06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		-	-
应付证券清算款		2,891,369.52	9,338.23
应付赎回款		4,282.16	968.86
应付管理人报酬		127,879.83	1,974.16
应付托管费		23,977.49	370.15
应付销售服务费		939.92	248.59
应付交易费用	6.4.7.7	357,535.55	2,118.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	76,944.66	1,086.96

负债合计		3,482,929.13	16,105.38
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	211,823,366.71	10,128,831.96
未分配利润	6.4.7.1 0	-11,605,624.91	-115,007.55
所有者权益合计		200,217,741.80	10,013,824.41
负债和所有者权益总计		203,700,670.93	10,029,929.79

注:1. 报告截止日2017年6月30日, 基金份额总额211,823,366.71份, 其中下属A类基金份额205,208,427.65份, C类基金份额6,614,939.06份。下属A类基金份额净值0.9452元, C类基金份额净值0.9446元。

2. 本基金合同生效日为2016年12月22日, 无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体: 创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期: 2017年01月01日至2017年06月30日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年06月30日
<b>一、收入</b>		-9,837,384.45
1. 利息收入		52,194.55
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	52,194.55
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)		-9,438,914.99
其中: 股票投资收益	6.4.7.12	-10,498,476.57
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-

股利收益	6.4.7.16	1,059,561.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-453,606.14
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	2,942.13
<b>减：二、费用</b>		2,758,232.44
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	766,741.96
2.托管费	6.4.10.2.2	143,764.16
3.销售服务费	6.4.10.2.3	5,312.94
4.交易费用	6.4.7.19	1,752,479.29
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	6.4.7.20	89,934.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,595,616.89
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,595,616.89

注：本基金合同生效日为2016年12月22日，无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06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)	10,128,831.96	-115,007.55	10,013,824.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-12,595,616.89	-12,595,616.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减)	201,694,534.75	1,104,999.53	202,799,534.28



少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	202, 703, 172. 1 4	1, 052, 059. 76	203, 755, 231. 90
2. 基金赎回款	-1, 008, 637. 39	52, 939. 77	-955, 697. 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）	211, 823, 366. 7 1	-11, 605, 624. 9 1	200, 217, 741. 80

注：本基金合同生效日为2016年12月22日，无上年度可比期间。

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：

苏彦祝

黄越岷

安兆国

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金(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[2016]第1918号《关于准予创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由创金合信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《创金合信中证1000指数增强型发起式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人民币10,115,380.08元，已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第1553号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于2016年12月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,115,717.42份基金份额，其中认购资金利息折合337.34份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括

国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品（包括权证、股指期货等）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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金可将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率  $\times 95\%$  + 一年期人民币定期存款利率（税后）  $\times 5\%$ 。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（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》、《创金合信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

#### 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所指定的重要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

至到期投资。

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

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

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

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

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于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确认。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：（1）在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的10%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；（4）同一类别的每一基金份额享有同等分配权。由于本基金A类基金份额与C类基金份额的基金费用不同，不同类别的基金份额对应的可供分配利润或将不同；（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协

(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 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06月30日
活期存款	8,347,583.67
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	0.00
合计	8,347,583.67

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	190,677,239.88	190,113,650.32	-563,589.56
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	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00
合计	190,677,239.88	190,113,650.32	-563,589.56

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应收活期存款利息	1,673.69
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	1,072.10
应收债券利息	0.00
应收买入返售证券利息	0.00
应收申购款利息	0.00
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	39.50
合计	2,785.29

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。



## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	357,535.55
银行间市场应付交易费用	0.00
合计	357,535.55

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	0.00
应付赎回费	0.00
预提费用	76,944.66
合计	76,944.66

## 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 创金合信中证1000增强A

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强A)	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,022,559.69	5,022,559.69
本期申购	200,323,128.84	200,323,128.84
本期赎回(以“-”号填列)	-137,260.88	-137,260.88
本期末	205,208,427.65	205,208,427.65

## 6.4.7.9.2 创金合信中证1000增强C

金额单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,106,272.27	5,106,272.27

本期申购	2,380,043.30	2,380,043.30
本期赎回（以“-”号填列）	-871,376.51	-871,376.51
本期末	6,614,939.06	6,614,939.06

注：申购含红利再投、转换入份(金)额，赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 创金合信中证1000增强A

单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,326.70	-54,576.76	-56,903.46
本期利润	-11,802,858.89	-549,864.20	-12,352,723.09
本期基金份额交易产生的变动数	-693,383.30	1,863,683.98	1,170,300.68
其中：基金申购款	-698,733.51	1,861,418.95	1,162,685.44
基金赎回款	5,350.21	2,265.03	7,615.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,498,568.89	1,259,243.02	-11,239,325.87

##### 6.4.7.10.2 创金合信中证1000增强C

单位：人民币元

项目 (创金合信中证1000增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,618.03	-55,486.06	-58,104.09
本期利润	-339,151.86	96,258.06	-242,893.80
本期基金份额交易产生的变动数	-65,075.70	-225.45	-65,301.15
其中：基金申购款	-99,875.31	-10,750.37	-110,625.68
基金赎回款	34,799.61	10,524.92	45,324.53
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-406,845.59	40,546.55	-366,299.04
-----	-------------	-----------	-------------

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日
活期存款利息收入	38,779.03
定期存款利息收入	0.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,789.44
其他	626.08
合计	52,194.55

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
卖出股票成交总额	1,049,925,425.34
减：卖出股票成本总额	1,060,423,901.91
买卖股票差价收入	-10,498,476.57

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	1,059,561.58
基金投资产生的股利收益	0.00
合计	1,059,561.58

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
1. 交易性金融资产	-453,606.14
——股票投资	-453,606.14
——债券投资	0.00
——资产支持证券投资	0.00
——基金投资	0.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	0.00
——权证投资	0.00
3. 其他	0.00
合计	-453,606.14

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
基金赎回费收入	2,942.13
合计	2,942.13

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
交易所市场交易费用	1,752,479.29

银行间市场交易费用	0.00
合计	1,752,479.29

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	2,439.43
帐户维护费	550.00
指数使用费	20,000.00
合计	89,934.09

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	关联方与本基金的关系
创金合信基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

**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**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 债券交易**

本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本基金于本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金于本期无应付关联方的佣金。

**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01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	766,741.96
其中：支付销售机构的客户维护费	2,869.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	143,764.16

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 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01月01日至2017年06月30日		
	创金合信中证1000增强 A	创金合信中证1000增强 C	合计
创金合信基金	-	4,273.25	4,273.25
合计	-	4,273.25	4,273.25

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金的基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=C类基金前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场债券（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

创金合信中证1000增强A

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2 017年06月30日
基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	5,000,166.70
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,166.70
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

创金合信中证1000增强C

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2 017年06月30日
基金合同生效日（2016年12月22日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	5,000,166.66
报告期内申购/买入总份额	-
报告期内因拆分变动份额	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	5,000,166.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-

## 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

## 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01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司活期存款	8,347,583.67	38,779.03

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2017年06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

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
代码	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	期末 成本 总额	期末 估值 总额	说明
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发 流通 受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发 流通 受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发 流通 受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发 流通 受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
30067	大烨	2017-	2017-	新发	10.93	10.93	1,259	13,76	13,76	-

0	智能	06-26	07-03	流通受限				0.87	0.87	
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	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

代码	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	期末成本总额	期末估值总额	备注说明
600602	云赛智联	2017-06-22	重大事项停牌	7.51	2017-07-04	7.80	283,300	2,269,873.37	2,127,583.00	-
000038	深大通	2017-05-12	重大事项停牌	31.74	-	-	53,800	1,924,645.19	1,707,612.00	-
600603	广汇物流	2017-06-15	重大事项停牌	11.81	2017-07-27	11.71	138,400	1,618,722.53	1,634,504.00	-
000889	茂业通信	2017-04-14	重大事项停牌	16.71	-	-	58,200	1,019,344.00	972,522.00	-
60005	象屿	2017-	重大	10.17	2017-	10.17	65,70	653,2	668,1	-

7	股份	06-27	事项 停牌		07-04		0	70.00	69.00	
300271	华宇 软件	2017- 06-22	重大 事项 停牌	16.59	2017- 07-04	16.80	33,900	559,251.00	562,401.00	-
300252	金信 诺	2017- 04-27	重大 事项 停牌	21.65	2017- 07-27	19.49	15,348	445,718.45	332,284.20	-
600490	鹏欣 资源	2017- 02-21	重大 事项 停牌	7.91	-	-	19,200	152,157.86	151,872.00	-
002622	融钰 集团	2017- 04-20	重大 事项 停牌	12.30	-	-	4,900	71,011.64	60,270.00	-
600634	富控 互动	2017- 04-19	重大 事项 停牌	18.03	2017- 07-17	17.21	2,600	54,740.00	46,878.00	-
002606	大连 电瓷	2017- 03-02	重大 事项 停牌	20.87	-	-	2,200	57,310.92	45,914.00	-
000034	神州 数码	2017- 03-21	重大 事项 停牌	24.45	2017- 07-18	22.01	500	11,680.00	12,225.00	-

#### 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为0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年6月30日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、监察稽核部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行农业银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等利率债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请

的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦在证券交易所上市交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,347,583.67	-	-	-	8,347,583.67
结算备付金	2,382,382.	-	-	-	2,382,382.1

	16				6
存出保证金	87,712.97	-	-	-	87,712.97
交易性金融资产	-	-	-	190,113,650.32	190,113,650.32
应收证券清算款	-	-	-	2,761,010.62	2,761,010.62
应收利息	-	-	-	2,785.29	2,785.29
应收申购款	-	-	-	5,545.90	5,545.90
资产总计	10,817,678.80	-	-	192,882,992.13	203,700,670.93
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,891,369.52	2,891,369.52
应付赎回款	-	-	-	4,282.16	4,282.16
应付管理人报酬	-	-	-	127,879.83	127,879.83
应付托管费	-	-	-	23,977.49	23,977.49
应付销售服务费	-	-	-	939.92	939.92
应付交易费用	-	-	-	357,535.55	357,535.55
其他负债	-	-	-	76,944.66	76,944.66
负债总计	-	-	-	3,482,929.13	3,482,929.13
利率敏感度缺口	10,817,678.80	-	-	189,400,063.00	200,217,741.80
上年度末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	518,397.12	-	-	-	518,397.12
交易性金融资产	-	-	-	9,503,201.00	9,503,201.00
应收证券清算款	-	-	-	7,258.41	7,258.41
应收利息	-	-	-	1,073.26	1,073.26
资产总计	518,397.12	-	-	9,511,532.6	10,029,929.

				7	79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,338.23	9,338.23
应付赎回款	-	-	-	968.86	968.86
应付管理人报酬	-	-	-	1,974.16	1,974.16
应付托管费	-	-	-	370.15	370.15
应付销售服务费	-	-	-	248.59	248.59
应付交易费用	-	-	-	2,118.43	2,118.43
其他负债	-	-	-	1,086.96	1,086.96
负债总计	-	-	-	16,105.38	16,105.38
利率敏感度缺口	518,397.12	-	-	9,495,427.29	10,013,824.41

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

市场利率的变动对基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,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投资比例为基金总资产的0-95%,基金持有全部权

证的市值不超过基金资产净值的3%，债券、中期票据、中小企业私募债券、资产支持证券、货币市场工具、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具的投资比例为基金资产的5%-100%。其中，本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年06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	190,113,650.32	94.95	9,503,201.00	94.90
交易性金融资产-基金投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-债券投资	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	-	-	-	-
合计	190,113,650.32	94.95	9,503,201.00	94.90

#### 6.4.13.4.3.2 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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	9,236,825.79	-
比较基准下降5%资产净值变动	-9,236,825.79	-	



#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于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属于第一层次的余额为181,667,733.02元，属于第二层次的余额为8,445,917.30元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次9,379,307.00元，第二层次123,894.00元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (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2017年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016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。

## § 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	190,113,650.32	93.33
	其中：股票	190,113,650.32	93.33
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	10,729,965.83	5.27
7	其他各项资产	2,857,054.78	1.40
8	合计	203,700,670.93	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,979,739.00	1.99
C	制造业	113,364,311.47	56.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,806,751.00	0.90
E	建筑业	1,954,648.15	0.98
F	批发和零售业	2,804,847.42	1.40
G	交通运输、仓储和邮政业	4,490,544.00	2.24

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	12,310,400.98	6.15
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,133,573.48	2.06
L	租赁和商务服务业	7,010,223.10	3.50
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	2,147,672.59	1.07
S	综合	-	-
	合计	154,002,711.19	76.92

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,862,922.00	0.93
B	采矿业	1,076,295.00	0.54
C	制造业	18,639,045.72	9.31
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	3,635,001.93	1.82
E	建筑业	1,903,182.00	0.95
F	批发和零售业	487,944.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政 业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息	2,655,948.42	1.33

	技术服务业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	2,486,101.00	1.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,729,995.06	0.86
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	1,634,504.00	0.82
	合计	36,110,939.13	18.04

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	600567	山鹰纸业	664,000	2,377,120.00	1.19
2	601666	平煤股份	444,600	2,343,042.00	1.17
3	600269	赣粤高速	448,500	2,336,685.00	1.17
4	600438	通威股份	416,900	2,326,302.00	1.16
5	300316	晶盛机电	184,200	2,300,658.00	1.15
6	002445	中南文化	177,800	2,284,730.00	1.14
7	002335	科华恒盛	63,400	2,246,896.00	1.12
8	600641	万业企业	201,003	2,243,193.48	1.12
9	300323	华灿光电	160,600	2,229,128.00	1.11
10	600261	阳光照明	338,800	2,225,916.00	1.11
11	600742	一汽富维	115,500	2,207,205.00	1.10

12	002376	新北洋	159,729	2,191,481.88	1.09
13	002537	海立美达	179,006	2,180,293.08	1.09
14	000739	普洛药业	295,500	2,168,970.00	1.08
15	300307	慈星股份	213,917	2,164,840.04	1.08
16	600035	楚天高速	390,900	2,153,859.00	1.08
17	002481	双塔食品	322,500	2,151,075.00	1.07
18	000719	大地传媒	205,913	2,147,672.59	1.07
19	300185	通裕重工	820,200	2,140,722.00	1.07
20	601388	怡球资源	603,600	2,136,744.00	1.07
21	600602	云赛智联	283,300	2,127,583.00	1.06
22	002538	司尔特	236,200	2,123,438.00	1.06
23	601700	风范股份	354,200	2,121,658.00	1.06
24	002210	飞马国际	123,230	2,115,859.10	1.06
25	002247	帝龙文化	161,266	2,115,809.92	1.06
26	002630	华西能源	182,500	2,115,175.00	1.06
27	002091	江苏国泰	220,850	2,109,117.50	1.05
28	600105	永鼎股份	260,700	2,103,849.00	1.05
29	002433	太安堂	226,500	2,095,125.00	1.05
30	600986	科达股份	152,610	2,069,391.60	1.03
31	300269	联建光电	102,900	2,061,087.00	1.03
32	002226	江南化工	292,400	2,058,496.00	1.03
33	000553	沙隆达 A	147,900	2,046,936.00	1.02
34	002324	普利特	76,000	2,042,880.00	1.02
35	002111	威海广泰	112,514	2,039,878.82	1.02
36	002528	英飞拓	343,601	2,037,553.93	1.02
37	000990	诚志股份	127,300	2,034,254.00	1.02
38	002102	冠福股份	486,242	2,032,491.56	1.02
39	002546	新联电子	339,826	2,021,964.70	1.01
40	000782	美达股份	214,400	2,019,648.00	1.01
41	002496	辉丰股份	405,300	2,010,288.00	1.00
42	002401	中远海科	151,200	1,988,280.00	0.99

43	000733	振华科技	123,900	1,970,010.00	0.98
44	300303	聚飞光电	454,900	1,969,717.00	0.98
45	300194	福安药业	283,000	1,966,850.00	0.98
46	600218	全柴动力	216,000	1,941,840.00	0.97
47	002212	南洋股份	151,900	1,939,763.00	0.97
48	300468	四方精创	43,382	1,934,403.38	0.97
49	002235	安妮股份	158,500	1,933,700.00	0.97
50	002574	明牌珠宝	221,602	1,927,937.40	0.96
51	000498	山东路桥	268,921	1,922,785.15	0.96
52	000570	苏常柴 A	273,276	1,912,932.00	0.96
53	002535	林州重机	362,100	1,911,888.00	0.95
54	300456	耐威科技	50,800	1,893,824.00	0.95
55	601588	北辰实业	304,900	1,890,380.00	0.94
56	002452	长高集团	274,700	1,887,189.00	0.94
57	002484	江海股份	186,717	1,852,232.64	0.93
58	002737	葵花药业	58,800	1,811,040.00	0.90
59	000936	华西股份	256,200	1,798,524.00	0.90
60	002677	浙江美大	128,600	1,791,398.00	0.89
61	000038	深大通	53,800	1,707,612.00	0.85
62	300353	东土科技	129,700	1,670,536.00	0.83
63	600449	宁夏建材	170,800	1,641,388.00	0.82
64	002511	中顺洁柔	114,400	1,513,512.00	0.76
65	002436	兴森科技	200,400	1,262,520.00	0.63
66	603808	歌力思	42,300	1,248,696.00	0.62
67	600990	四创电子	18,900	1,171,611.00	0.59
68	002519	银河电子	148,510	1,168,773.70	0.58
69	000789	万年青	161,800	1,147,162.00	0.57
70	002100	天康生物	141,300	1,134,639.00	0.57
71	002203	海亮股份	127,000	1,033,780.00	0.52
72	601339	百隆东方	166,700	991,865.00	0.50
73	000889	茂业通信	58,200	972,522.00	0.49

74	000902	新洋丰	107,800	970,200.00	0.48
75	601199	江南水务	136,100	935,007.00	0.47
76	600508	上海能源	79,100	923,097.00	0.46
77	000971	高升控股	53,900	904,981.00	0.45
78	000591	太阳能	169,600	871,744.00	0.44
79	300118	东方日升	58,300	819,115.00	0.41
80	000688	建新矿业	89,200	713,600.00	0.36
81	002777	久远银海	10,100	702,960.00	0.35
82	600057	象屿股份	65,700	668,169.00	0.33
83	600382	广东明珠	45,612	657,268.92	0.33
84	300031	宝通科技	33,800	621,582.00	0.31
85	300271	华宇软件	33,900	562,401.00	0.28
86	002712	思美传媒	21,200	457,496.00	0.23
87	002362	汉王科技	19,300	391,983.00	0.20
88	300054	鼎龙股份	38,500	391,545.00	0.20
89	000055	方大集团	51,800	377,104.00	0.19
90	002521	齐峰新材	35,900	354,692.00	0.18
91	300252	金信诺	15,348	332,284.20	0.17
92	300312	邦讯技术	17,800	225,348.00	0.11
93	603118	共进股份	16,300	222,169.00	0.11
94	000837	秦川机床	26,700	192,774.00	0.10
95	300050	世纪鼎利	15,300	154,071.00	0.08
96	600490	鹏欣资源	19,200	151,872.00	0.08
97	300317	珈伟股份	4,746	69,291.60	0.03
98	002622	融钰集团	4,900	60,270.00	0.03
99	300342	天银机电	3,700	56,462.00	0.03
100	300410	正业科技	1,400	50,540.00	0.03
101	600634	富控互动	2,600	46,878.00	0.02
102	002606	大连电瓷	2,200	45,914.00	0.02
103	002759	天际股份	1,300	33,241.00	0.02
104	600846	同济科技	3,900	31,863.00	0.02

105	600090	同济堂	2,800	26,236.00	0.01
106	000034	神州数码	500	12,225.00	0.01

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量	期末公允价值	公允价值占基金资产净值比例 (%)
1	300182	捷成股份	233,480	2,232,068.80	1.11
2	600736	苏州高新	290,300	2,052,421.00	1.03
3	300360	炬华科技	127,600	1,920,380.00	0.96
4	000813	德展健康	220,150	1,899,894.50	0.95
5	600864	哈投股份	226,303	1,880,577.93	0.94
6	300158	振东制药	115,770	1,877,789.40	0.94
7	000711	京蓝科技	123,700	1,862,922.00	0.93
8	600512	腾达建设	377,000	1,858,610.00	0.93
9	600960	渤海活塞	242,400	1,849,512.00	0.92
10	600429	三元股份	274,300	1,791,179.00	0.89
11	002514	宝馨科技	220,500	1,779,435.00	0.89
12	600167	联美控股	82,600	1,754,424.00	0.88
13	603017	中衡设计	98,407	1,729,995.00	0.86



				6	
14	600603	广汇物流	138,400	1,634,504.00	0.82
15	002370	亚太药业	52,417	1,536,866.44	0.77
16	600499	科达洁能	180,600	1,433,964.00	0.72
17	600028	中国石化	181,500	1,076,295.00	0.54
18	002286	保龄宝	85,300	1,063,691.00	0.53
19	000761	本钢板材	190,900	998,407.00	0.50
20	000066	中国长城	83,200	749,632.00	0.37
21	000959	首钢股份	101,200	707,388.00	0.35
22	002309	中利集团	47,000	587,970.00	0.29
23	600297	广汇汽车	64,800	487,944.00	0.24
24	000732	泰禾集团	26,000	433,680.00	0.22
25	002093	国脉科技	47,300	416,240.00	0.21
26	002003	伟星股份	5,900	61,655.00	0.03
27	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
28	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
29	002775	文科园林	2,200	44,572.00	0.02
30	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
31	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
32	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
33	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
34	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
35	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
36	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
37	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
38	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01

39	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
40	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
41	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
42	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
43	603331	百达精工	999	9,620.37	-
44	300671	富满电子	942	7,639.62	-
45	603617	君禾股份	832	7,429.76	-

## 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	000046	泛海控股	8,458,757.20	84.47
2	002511	中顺洁柔	7,273,756.05	72.64
3	002546	新联电子	7,036,606.82	70.27
4	000936	华西股份	7,024,497.72	70.15
5	600269	赣粤高速	6,933,338.40	69.24
6	600713	南京医药	6,642,611.19	66.33
7	601567	三星医疗	6,535,743.74	65.27
8	300339	润和软件	6,520,342.59	65.11
9	600028	中国石化	6,285,973.00	62.77
10	000761	本钢板材	6,135,819.34	61.27
11	002445	中南文化	6,112,073.00	61.04
12	600711	盛屯矿业	6,107,494.00	60.99
13	002737	葵花药业	6,089,828.77	60.81
14	600261	阳光照明	6,035,529.41	60.27
15	601339	百隆东方	5,930,047.22	59.22
16	002380	科远股份	5,890,861.10	58.83
17	600986	科达股份	5,886,214.99	58.78
18	002441	众业达	5,833,078.39	58.25

19	002712	思美传媒	5,721,858.65	57.14
20	600990	四创电子	5,554,992.89	55.47
21	000782	美达股份	5,545,582.00	55.38
22	300312	邦讯技术	5,537,683.66	55.30
23	002519	银河电子	5,519,771.50	55.12
24	300248	新开普	5,474,004.04	54.66
25	002484	江海股份	5,432,040.50	54.25
26	002093	国脉科技	5,413,927.61	54.06
27	600218	全柴动力	5,353,392.95	53.46
28	600742	一汽富维	5,303,608.65	52.96
29	600530	交大昂立	5,213,817.50	52.07
30	603808	歌力思	5,189,934.60	51.83
31	600167	联美控股	5,178,854.38	51.72
32	600499	科达洁能	5,158,783.44	51.52
33	600090	同济堂	5,144,419.99	51.37
34	300360	炬华科技	5,092,548.12	50.86
35	600515	海航基础	5,077,699.99	50.71
36	000591	太阳能	5,017,327.68	50.10
37	600438	通威股份	4,989,077.30	49.82
38	300303	聚飞光电	4,977,014.00	49.70
39	002102	冠福股份	4,912,003.84	49.05
40	300456	耐威科技	4,850,757.93	48.44
41	002528	英飞拓	4,775,276.28	47.69
42	000813	德展健康	4,750,750.50	47.44
43	002203	海亮股份	4,630,474.30	46.24
44	601636	旗滨集团	4,619,808.00	46.13
45	603017	中衡设计	4,587,253.73	45.81
46	000676	智度股份	4,567,036.50	45.61
47	300269	联建光电	4,549,352.22	45.43
48	601877	正泰电器	4,537,811.30	45.32
49	300130	新国都	4,521,294.86	45.15

50	002608	江苏国信	4,509,539.05	45.03
51	300307	慈星股份	4,476,461.96	44.70
52	002309	中利集团	4,469,985.00	44.64
53	300451	创业软件	4,467,424.00	44.61
54	002777	久远银海	4,392,805.96	43.87
55	601700	风范股份	4,362,284.50	43.56
56	601368	绿城水务	4,309,721.05	43.04
57	600603	广汇物流	4,262,309.52	42.56
58	002630	华西能源	4,226,413.00	42.21
59	000739	普洛药业	4,204,354.00	41.99
60	600382	广东明珠	4,198,985.16	41.93
61	002481	双塔食品	4,196,353.00	41.91
62	600486	扬农化工	4,176,222.22	41.70
63	600589	广东榕泰	4,127,884.99	41.22
64	300184	力源信息	4,069,376.00	40.64
65	002469	三维工程	4,058,516.00	40.53
66	000070	特发信息	4,051,361.28	40.46
67	300468	四方精创	4,048,903.73	40.43
68	002425	凯撒文化	4,042,348.00	40.37
69	300381	溢多利	3,973,314.79	39.68
70	000959	首钢股份	3,969,774.00	39.64
71	600982	宁波热电	3,966,921.87	39.61
72	300316	晶盛机电	3,965,154.82	39.60
73	600168	武汉控股	3,960,695.83	39.55
74	300064	豫金刚石	3,949,915.42	39.44
75	000899	赣能股份	3,944,926.00	39.39
76	002626	金达威	3,931,373.00	39.26
77	002338	奥普光电	3,928,967.50	39.24
78	600105	永鼎股份	3,922,410.90	39.17
79	603599	广信股份	3,889,033.48	38.84
80	600035	楚天高速	3,882,355.00	38.77

81	000404	华意压缩	3,872,421.00	38.67
82	002100	天康生物	3,836,121.01	38.31
83	600470	六国化工	3,820,647.00	38.15
84	601388	怡球资源	3,802,619.05	37.97
85	600548	深高速	3,799,502.88	37.94
86	002370	亚太药业	3,769,171.21	37.64
87	300366	创意信息	3,751,791.00	37.47
88	000564	供销大集	3,692,932.64	36.88
89	002313	日海通讯	3,679,086.73	36.74
90	600429	三元股份	3,676,865.00	36.72
91	300494	盛天网络	3,655,285.10	36.50
92	002147	新光圆成	3,648,974.90	36.44
93	002228	合兴包装	3,642,477.00	36.37
94	002636	金安国纪	3,640,688.25	36.36
95	000043	中航地产	3,602,013.00	35.97
96	002531	天顺风能	3,598,895.00	35.94
97	600052	浙江广厦	3,592,019.00	35.87
98	300323	华灿光电	3,563,553.00	35.59
99	002376	新北洋	3,539,347.62	35.34
100	600395	盘江股份	3,524,049.99	35.19
101	600845	宝信软件	3,496,789.76	34.92
102	300158	振东制药	3,495,593.90	34.91
103	300373	扬杰科技	3,461,707.06	34.57
104	002433	太安堂	3,401,675.00	33.97
105	002062	宏润建设	3,401,249.24	33.97
106	002781	奇信股份	3,397,161.22	33.92
107	600420	现代制药	3,392,653.59	33.88
108	000601	韶能股份	3,372,873.00	33.68
109	002369	卓翼科技	3,370,666.21	33.66
110	002452	长高集团	3,359,133.90	33.54
111	000951	中国重汽	3,304,516.25	33.00

112	002212	南洋股份	3,291,005.00	32.86
113	000055	方大集团	3,280,796.50	32.76
114	002080	中材科技	3,244,604.56	32.40
115	300102	乾照光电	3,231,955.00	32.27
116	600114	东睦股份	3,228,859.00	32.24
117	002121	科陆电子	3,216,215.00	32.12
118	300050	世纪鼎利	3,199,049.41	31.95
119	600508	上海能源	3,159,766.69	31.55
120	000553	沙隆达 A	3,130,156.00	31.26
121	600255	鑫科材料	3,105,697.00	31.01
122	000733	振华科技	3,103,136.00	30.99
123	002449	国星光电	3,086,868.53	30.83
124	300031	宝通科技	3,009,570.00	30.05
125	002247	帝龙文化	2,997,317.92	29.93
126	600602	云赛智联	2,989,448.74	29.85
127	002111	威海广泰	2,983,201.52	29.79
128	002324	普利特	2,962,607.54	29.59
129	600864	哈投股份	2,949,100.67	29.45
130	002574	明牌珠宝	2,933,303.78	29.29
131	000688	建新矿业	2,927,894.96	29.24
132	300054	鼎龙股份	2,896,732.20	28.93
133	002235	安妮股份	2,895,686.86	28.92
134	601799	星宇股份	2,891,895.98	28.88
135	000525	红太阳	2,852,205.00	28.48
136	000038	深大通	2,847,666.14	28.44
137	002537	海立美达	2,833,176.24	28.29
138	000498	山东路桥	2,825,819.33	28.22
139	000570	苏常柴 A	2,809,679.69	28.06
140	603686	龙马环卫	2,799,997.93	27.96
141	600641	万业企业	2,788,464.56	27.85
142	002064	华峰氨纶	2,785,677.74	27.82

143	002683	宏大爆破	2,776,624.20	27.73
144	600567	山鹰纸业	2,776,454.00	27.73
145	600562	国睿科技	2,771,840.40	27.68
146	002210	飞马国际	2,766,081.22	27.62
147	002435	长江润发	2,730,169.63	27.26
148	002091	江苏国泰	2,706,038.44	27.02
149	600409	三友化工	2,689,673.00	26.86
150	002421	达实智能	2,684,795.05	26.81
151	002535	林州重机	2,681,055.95	26.77
152	300279	和晶科技	2,667,501.64	26.64
153	300193	佳士科技	2,658,260.32	26.55
154	603118	共进股份	2,653,338.00	26.50
155	000898	鞍钢股份	2,650,896.28	26.47
156	002496	辉丰股份	2,634,668.00	26.31
157	002171	楚江新材	2,628,289.00	26.25
158	600676	交运股份	2,625,520.00	26.22
159	600077	宋都股份	2,616,643.65	26.13
160	603128	华贸物流	2,614,872.00	26.11
161	300228	富瑞特装	2,611,546.40	26.08
162	300419	浩丰科技	2,600,269.00	25.97
163	300353	东土科技	2,597,524.00	25.94
164	603368	柳州医药	2,576,691.64	25.73
165	002514	宝馨科技	2,552,628.00	25.49
166	002429	兆驰股份	2,551,061.00	25.48
167	002322	理工环科	2,509,434.23	25.06
168	600512	腾达建设	2,505,939.00	25.02
169	600960	渤海活塞	2,494,530.76	24.91
170	300297	蓝盾股份	2,485,579.08	24.82
171	002296	辉煌科技	2,483,992.00	24.81
172	002226	江南化工	2,481,323.00	24.78
173	000990	诚志股份	2,464,768.00	24.61

174	603996	中新科技	2,460,907.50	24.58
175	603609	禾丰牧业	2,445,744.00	24.42
176	600736	苏州高新	2,397,735.08	23.94
177	300047	天源迪科	2,393,303.98	23.90
178	600527	江南高纤	2,372,373.00	23.69
179	000518	四环生物	2,368,083.75	23.65
180	002401	中远海科	2,355,214.17	23.52
181	300185	通裕重工	2,347,883.00	23.45
182	600730	中国高科	2,329,194.00	23.26
183	300008	天海防务	2,321,632.50	23.18
184	601666	平煤股份	2,311,089.00	23.08
185	000932	*ST华菱	2,287,048.08	22.84
186	600229	城市传媒	2,267,219.25	22.64
187	600667	太极实业	2,253,796.00	22.51
188	300071	华谊嘉信	2,234,499.54	22.31
189	000901	航天科技	2,228,526.96	22.25
190	600775	南京熊猫	2,221,762.92	22.19
191	300182	捷成股份	2,220,439.70	22.17
192	002335	科华恒盛	2,218,818.40	22.16
193	002288	超华科技	2,213,550.00	22.10
194	002604	龙力生物	2,209,211.00	22.06
195	601616	广电电气	2,208,825.04	22.06
196	002020	京新药业	2,200,417.00	21.97
197	600094	大名城	2,191,706.00	21.89
198	002521	齐峰新材	2,188,799.00	21.86
199	600185	格力地产	2,163,589.83	21.61
200	000719	大地传媒	2,154,271.47	21.51
201	300318	博晖创新	2,151,769.57	21.49
202	300349	金卡智能	2,151,271.00	21.48
203	002538	司尔特	2,148,614.00	21.46
204	002094	青岛金王	2,147,239.81	21.44



205	300204	舒泰神	2,138,577.72	21.36
206	300317	珈伟股份	2,130,026.00	21.27
207	000551	创元科技	2,129,153.76	21.26
208	600310	桂东电力	2,126,105.00	21.23
209	000042	中洲控股	2,118,361.00	21.15
210	600756	浪潮软件	2,106,741.00	21.04
211	600661	新南洋	2,105,971.00	21.03
212	300118	东方日升	2,096,517.00	20.94
213	002037	久联发展	2,089,076.06	20.86
214	600075	新疆天业	2,062,616.20	20.60
215	002039	黔源电力	2,053,164.00	20.50
216	300232	洲明科技	2,050,027.00	20.47
217	600191	华资实业	2,046,646.98	20.44
218	000948	南天信息	2,039,596.00	20.37
219	000700	模塑科技	2,038,454.00	20.36
220	600057	象屿股份	2,012,560.00	20.10
221	300194	福安药业	2,005,471.02	20.03
222	002529	海源机械	1,994,266.00	19.92
223	603828	柯利达	1,993,843.88	19.91
224	300189	神农基因	1,989,864.00	19.87
225	002667	鞍重股份	1,983,691.00	19.81
226	002021	中捷资源	1,980,546.00	19.78
227	300439	美康生物	1,973,296.51	19.71
228	300048	合康新能	1,967,823.16	19.65
229	000058	深赛格	1,967,252.00	19.65
230	601588	北辰实业	1,962,755.00	19.60
231	002286	保龄宝	1,960,253.00	19.58
232	000971	高升控股	1,941,010.04	19.38
233	002224	三力士	1,935,630.00	19.33
234	600346	恒力股份	1,932,095.00	19.29
235	300171	东富龙	1,911,318.33	19.09

236	002432	九安医疗	1,902,184.00	19.00
237	600278	东方创业	1,895,081.04	18.92
238	002090	金智科技	1,885,230.46	18.83
239	002518	科士达	1,882,512.81	18.80
240	600273	嘉化能源	1,874,881.00	18.72
241	000705	浙江震元	1,851,303.00	18.49
242	600745	中茵股份	1,850,870.00	18.48
243	000850	华茂股份	1,847,262.00	18.45
244	002109	兴化股份	1,840,531.00	18.38
245	300190	维尔利	1,838,450.00	18.36
246	300162	雷曼股份	1,837,276.00	18.35
247	600377	宁沪高速	1,832,874.00	18.30
248	000711	京蓝科技	1,827,958.00	18.25
249	600879	航天电子	1,826,157.00	18.24
250	002677	浙江美大	1,818,047.00	18.16
251	601199	江南水务	1,812,111.00	18.10
252	300195	长荣股份	1,800,100.00	17.98
253	002609	捷顺科技	1,792,875.98	17.90
254	300342	天银机电	1,785,831.46	17.83
255	300041	回天新材	1,782,105.00	17.80
256	002662	京威股份	1,779,015.20	17.77
257	300165	天瑞仪器	1,778,527.00	17.76
258	600526	菲达环保	1,753,638.00	17.51
259	002763	汇洁股份	1,753,484.72	17.51
260	300485	赛升药业	1,751,494.00	17.49
261	002775	文科园林	1,748,795.00	17.46
262	300123	太阳鸟	1,748,680.00	17.46
263	002771	真视通	1,740,641.00	17.38
264	000732	泰禾集团	1,737,034.62	17.35
265	002148	北纬通信	1,725,478.63	17.23
266	600162	香江控股	1,716,123.10	17.14

267	002144	宏达高科	1,712,333.00	17.10
268	002545	东方铁塔	1,692,344.00	16.90
269	600963	岳阳林纸	1,684,995.00	16.83
270	600502	安徽水利	1,668,692.00	16.66
271	600449	宁夏建材	1,646,954.00	16.45
272	002454	松芝股份	1,641,454.12	16.39
273	002612	朗姿股份	1,633,682.20	16.31
274	603018	中设集团	1,625,434.00	16.23
275	002624	完美世界	1,624,958.80	16.23
276	300083	劲胜智能	1,619,650.00	16.17
277	002766	索菱股份	1,612,069.78	16.10
278	600862	中航高科	1,610,055.00	16.08
279	600172	黄河旋风	1,559,717.18	15.58
280	600771	广誉远	1,536,527.00	15.34
281	002411	必康股份	1,523,918.00	15.22
282	002372	伟星新材	1,521,366.17	15.19
283	600323	瀚蓝环境	1,483,103.88	14.81
284	600728	佳都科技	1,473,486.39	14.71
285	601058	赛轮金宇	1,462,459.80	14.60
286	600885	宏发股份	1,444,019.00	14.42
287	600461	洪城水业	1,442,982.00	14.41
288	002003	伟星股份	1,439,622.64	14.38
289	300310	宜通世纪	1,419,055.00	14.17
290	600613	神奇制药	1,407,964.28	14.06
291	300068	南都电源	1,405,274.00	14.03
292	000036	华联控股	1,390,751.00	13.89
293	000795	英洛华	1,370,984.00	13.69
294	002559	亚威股份	1,360,785.25	13.59
295	002393	力生制药	1,347,712.00	13.46
296	601599	鹿港文化	1,345,147.00	13.43
297	603566	普莱柯	1,345,136.28	13.43

298	601225	陕西煤业	1,338,479.00	13.37
299	000637	茂化实华	1,331,026.48	13.29
300	600405	动力源	1,330,535.00	13.29
301	002583	海能达	1,326,624.00	13.25
302	002023	海特高新	1,322,674.00	13.21
303	002434	万里扬	1,316,039.00	13.14
304	600363	联创光电	1,315,052.55	13.13
305	300040	九洲电气	1,313,247.00	13.11
306	000807	云铝股份	1,312,980.00	13.11
307	000789	万年青	1,309,156.00	13.07
308	000790	泰合健康	1,299,457.27	12.98
309	002392	北京利尔	1,298,153.92	12.96
310	000429	粤高速 A	1,297,958.00	12.96
311	300241	瑞丰光电	1,294,994.00	12.93
312	600033	福建高速	1,289,512.00	12.88
313	000910	大亚圣象	1,286,775.63	12.85
314	600677	航天通信	1,285,233.94	12.83
315	002462	嘉事堂	1,273,076.11	12.71
316	002617	露笑科技	1,265,800.00	12.64
317	002436	兴森科技	1,262,475.00	12.61
318	600622	嘉宝集团	1,256,161.00	12.54
319	000657	中钨高新	1,253,417.00	12.52
320	600188	兖州煤业	1,251,388.97	12.50
321	300285	国瓷材料	1,249,012.71	12.47
322	300138	晨光生物	1,246,994.02	12.45
323	300252	金信诺	1,238,295.16	12.37
324	000796	凯撒旅游	1,237,573.00	12.36
325	000030	富奥股份	1,236,767.00	12.35
326	002334	英威腾	1,219,422.00	12.18
327	600595	中孚实业	1,212,819.99	12.11
328	600093	易见股份	1,208,023.06	12.06

329	600211	西藏药业	1,207,343.00	12.06
330	300183	东软载波	1,202,483.00	12.01
331	000915	山大华特	1,178,395.50	11.77
332	002686	亿利达	1,168,110.00	11.66
333	300337	银邦股份	1,167,133.30	11.66
334	002298	中电鑫龙	1,166,172.36	11.65
335	600396	金山股份	1,164,578.00	11.63
336	600063	皖维高新	1,158,928.00	11.57
337	600683	京投发展	1,154,998.06	11.53
338	600744	华银电力	1,149,273.00	11.48
339	000863	三湘印象	1,148,267.00	11.47
340	002362	汉王科技	1,142,395.00	11.41
341	002387	黑牛食品	1,142,064.24	11.40
342	600590	泰豪科技	1,140,609.00	11.39
343	300053	欧比特	1,138,296.00	11.37
344	600846	同济科技	1,138,121.58	11.37
345	000767	漳泽电力	1,125,120.00	11.24
346	601218	吉鑫科技	1,124,437.62	11.23
347	002156	通富微电	1,123,460.20	11.22
348	002188	巴士在线	1,115,029.00	11.13
349	000886	海南高速	1,107,700.00	11.06
350	000065	北方国际	1,106,692.00	11.05
351	300284	苏交科	1,104,611.00	11.03
352	002427	尤夫股份	1,099,992.00	10.98
353	603898	好莱客	1,098,284.86	10.97
354	300139	晓程科技	1,098,074.01	10.97
355	002448	中原内配	1,095,813.00	10.94
356	002446	盛路通信	1,092,571.10	10.91
357	600126	杭钢股份	1,091,873.00	10.90
358	002497	雅化集团	1,089,304.00	10.88
359	300157	恒泰艾普	1,088,821.85	10.87

360	000096	广聚能源	1,086,673.85	10.85
361	300438	鹏辉能源	1,084,072.50	10.83
362	002337	赛象科技	1,083,029.00	10.82
363	600866	星湖科技	1,080,832.00	10.79
364	002197	证通电子	1,080,613.00	10.79
365	002540	亚太科技	1,077,636.00	10.76
366	300038	梅泰诺	1,077,433.04	10.76
367	002126	银轮股份	1,076,614.27	10.75
368	601566	九牧王	1,075,887.60	10.74
369	002097	山河智能	1,074,987.00	10.74
370	002468	申通快递	1,074,390.00	10.73
371	300237	美晨科技	1,073,220.00	10.72
372	300004	南风股份	1,073,045.00	10.72
373	002502	骅威文化	1,071,845.16	10.70
374	603818	曲美家居	1,069,252.00	10.68
375	002086	东方海洋	1,067,615.00	10.66
376	300224	正海磁材	1,055,602.77	10.54
377	600501	航天晨光	1,054,970.00	10.54
378	601107	四川成渝	1,053,191.00	10.52
379	002259	升达林业	1,052,128.86	10.51
380	002256	兆新股份	1,046,791.00	10.45
381	002218	拓日新能	1,046,110.00	10.45
382	600190	锦州港	1,043,700.00	10.42
383	300214	日科化学	1,042,742.00	10.41
384	002483	润邦股份	1,040,383.38	10.39
385	000040	东旭蓝天	1,037,894.00	10.36
386	600531	豫光金铅	1,036,100.80	10.35
387	002060	粤水电	1,035,246.00	10.34
388	600552	凯盛科技	1,031,153.22	10.30
389	002597	金禾实业	1,029,176.00	10.28
390	000701	厦门信达	1,026,628.00	10.25

391	300309	吉艾科技	1,020,546.00	10.19
392	002619	巨龙管业	1,020,382.00	10.19
393	000889	茂业通信	1,019,344.00	10.18
394	300255	常山药业	1,008,743.00	10.07
395	002314	南山控股	1,007,874.10	10.06
396	600708	光明地产	1,005,970.00	10.05
397	300143	星普医科	1,001,304.00	10.00
398	300074	华平股份	1,001,219.00	10.00
399	002139	拓邦股份	999,725.00	9.98
400	002274	华昌化工	998,949.05	9.98
401	600206	有研新材	995,410.00	9.94
402	000066	中国长城	990,549.00	9.89
403	600246	万通地产	989,573.00	9.88
404	002103	广博股份	988,387.98	9.87
405	600726	华电能源	988,349.67	9.87
406	300177	中海达	986,539.00	9.85
407	002648	卫星石化	983,152.96	9.82
408	000811	烟台冰轮	980,784.00	9.79
409	000561	烽火电子	980,662.96	9.79
410	603338	浙江鼎力	979,940.50	9.79
411	002135	东南网架	978,454.00	9.77
412	002472	双环传动	975,634.76	9.74
413	000902	新洋丰	975,490.00	9.74
414	603939	益丰药房	969,993.00	9.69
415	002438	江苏神通	969,285.80	9.68
416	002079	苏州固锴	969,145.00	9.68
417	000531	穗恒运 A	966,873.00	9.66
418	002783	凯龙股份	963,981.00	9.63
419	300049	福瑞股份	961,777.00	9.60
420	300018	中元股份	961,719.00	9.60
421	002114	罗平锌电	958,142.00	9.57

422	300389	艾比森	956,776.80	9.55
423	000545	金浦钛业	954,817.00	9.53
424	002182	云海金属	954,256.00	9.53
425	000665	湖北广电	952,208.56	9.51
426	603008	喜临门	951,555.28	9.50
427	603012	创力集团	947,159.00	9.46
428	002383	合众思壮	942,058.93	9.41
429	002115	三维通信	937,811.00	9.37
430	603600	永艺股份	936,697.87	9.35
431	600658	电子城	936,170.00	9.35
432	300254	仟源医药	935,328.69	9.34
433	002279	久其软件	935,031.75	9.34
434	600128	弘业股份	934,761.56	9.33
435	000537	广宇发展	932,523.00	9.31
436	300328	宜安科技	929,113.92	9.28
437	603100	川仪股份	927,150.12	9.26
438	000589	黔轮胎 A	926,111.00	9.25
439	300256	星星科技	925,150.25	9.24
440	002567	唐人神	924,072.00	9.23
441	600136	当代明诚	916,452.00	9.15
442	002543	万和电气	910,297.56	9.09
443	002586	围海股份	910,283.00	9.09
444	300484	蓝海华腾	901,509.00	9.00
445	002457	青龙管业	900,077.00	8.99
446	300229	拓尔思	898,150.49	8.97
447	300495	美尚生态	897,563.20	8.96
448	300140	中环装备	897,214.03	8.96
449	300298	三诺生物	894,061.00	8.93
450	002592	八菱科技	889,463.94	8.88
451	300155	安居宝	888,579.00	8.87
452	002520	日发精机	885,770.00	8.85



453	300384	三联虹普	881,316.07	8.80
454	600738	兰州民百	874,790.00	8.74
455	300365	恒华科技	872,685.00	8.71
456	000546	金圆股份	869,366.00	8.68
457	600629	华建集团	867,985.65	8.67
458	002504	*ST弘高	867,339.00	8.66
459	002232	启明信息	863,828.64	8.63
460	300358	楚天科技	860,535.00	8.59
461	300448	浩云科技	859,679.00	8.58
462	000023	深天地 A	852,359.00	8.51
463	600550	保变电气	846,463.00	8.45
464	601038	一拖股份	841,847.00	8.41
465	300512	中亚股份	837,801.00	8.37
466	300151	昌红科技	837,058.50	8.36
467	002713	东易日盛	835,574.10	8.34
468	300511	雪榕生物	833,003.00	8.32
469	300508	维宏股份	827,172.00	8.26
470	300356	光一科技	817,596.56	8.16
471	603737	三棵树	815,747.00	8.15
472	300444	双杰电气	813,015.10	8.12
473	600210	紫江企业	809,471.00	8.08
474	002802	洪汇新材	801,511.00	8.00
475	300519	新光药业	797,719.00	7.97
476	300507	苏奥传感	794,288.00	7.93
477	600345	长江通信	791,508.00	7.90
478	300399	京天利	783,888.71	7.83
479	002750	龙津药业	774,528.00	7.73
480	600203	福日电子	774,411.00	7.73
481	600383	金地集团	773,639.00	7.73
482	600054	黄山旅游	769,703.28	7.69
483	600792	云煤能源	763,910.00	7.63

484	000965	天保基建	763,492.00	7.62
485	300522	世名科技	761,861.00	7.61
486	300293	蓝英装备	761,807.10	7.61
487	600573	惠泉啤酒	758,913.00	7.58
488	600186	莲花健康	756,502.00	7.55
489	300246	宝莱特	740,814.00	7.40
490	600685	中船防务	730,055.00	7.29
491	603567	珍宝岛	725,554.00	7.25
492	603788	宁波高发	721,749.76	7.21
493	603588	高能环境	719,586.02	7.19
494	600175	美都能源	718,522.00	7.18
495	600748	上实发展	716,660.00	7.16
496	600335	国机汽车	709,567.07	7.09
497	603166	福达股份	708,569.00	7.08
498	002160	常铝股份	706,568.00	7.06
499	300391	康跃科技	702,321.00	7.01
500	600825	新华传媒	698,551.98	6.98
501	600653	申华控股	697,814.00	6.97
502	000662	天夏智慧	696,364.93	6.95
503	002077	大港股份	695,728.84	6.95
504	002615	哈尔斯	694,486.00	6.94
505	300407	凯发电气	691,760.00	6.91
506	002480	新筑股份	686,639.00	6.86
507	002523	天桥起重	686,243.00	6.85
508	600569	安阳钢铁	682,862.00	6.82
509	002768	国恩股份	682,662.00	6.82
510	600664	哈药股份	680,837.00	6.80
511	000628	高新发展	680,081.00	6.79
512	002493	荣盛石化	678,231.99	6.77
513	000627	天茂集团	678,201.00	6.77
514	000880	潍柴重机	677,040.00	6.76

515	000021	深科技	675,165.00	6.74
516	600782	新钢股份	671,537.00	6.71
517	300462	华铭智能	669,505.00	6.69
518	600755	厦门国贸	667,346.00	6.66
519	600969	郴电国际	665,892.90	6.65
520	603116	红蜻蜓	663,409.00	6.62
521	300395	菲利华	660,003.26	6.59
522	002420	毅昌股份	658,671.00	6.58
523	600597	光明乳业	658,336.00	6.57
524	300509	新美星	657,946.00	6.57
525	600133	东湖高新	657,930.00	6.57
526	002146	荣盛发展	657,015.00	6.56
527	300121	阳谷华泰	656,805.00	6.56
528	000938	紫光股份	656,541.94	6.56
529	603366	日出东方	656,171.00	6.55
530	002382	蓝帆医疗	656,077.00	6.55
531	002534	杭锅股份	655,248.00	6.54
532	002056	横店东磁	652,158.59	6.51
533	300525	博思软件	650,706.35	6.50
534	002607	亚夏汽车	650,650.80	6.50
535	600600	青岛啤酒	650,348.00	6.49
536	002661	克明面业	650,033.00	6.49
537	002295	精艺股份	649,143.31	6.48
538	002150	通润装备	649,140.00	6.48
539	300282	汇冠股份	647,993.76	6.47
540	002190	成飞集成	647,985.00	6.47
541	600872	中炬高新	647,835.00	6.47
542	002165	红宝丽	647,638.00	6.47
543	600812	华北制药	647,578.00	6.47
544	600757	长江传媒	647,397.00	6.47
545	002398	建研集团	647,312.34	6.46

546	600020	中原高速	644,764.00	6.44
547	600894	广日股份	643,423.00	6.43
548	002637	赞宇科技	642,095.00	6.41
549	300108	双龙股份	642,030.00	6.41
550	002181	粤传媒	641,748.00	6.41
551	600350	山东高速	641,460.00	6.41
552	002350	北京科锐	641,310.00	6.40
553	600091	ST明科	641,223.00	6.40
554	300515	三德科技	641,173.00	6.40
555	300067	安诺其	641,154.00	6.40
556	600235	民丰特纸	641,142.35	6.40
557	600831	广电网络	641,119.00	6.40
558	002482	广田集团	641,002.50	6.40
559	002238	天威视讯	639,227.00	6.38
560	600529	山东药玻	639,128.16	6.38
561	002013	中航机电	638,733.00	6.38
562	603958	哈森股份	638,233.00	6.37
563	002778	高科石化	637,129.00	6.36
564	002258	利尔化学	637,106.00	6.36
565	002536	西泵股份	636,901.00	6.36
566	000949	新乡化纤	635,983.00	6.35
567	601313	江南嘉捷	635,445.49	6.35
568	601088	中国神华	633,803.01	6.33
569	002054	德美化工	633,802.94	6.33
570	002151	北斗星通	632,696.00	6.32
571	002563	森马服饰	631,569.00	6.31
572	600426	华鲁恒升	631,535.00	6.31
573	600302	标准股份	631,358.00	6.30
574	002593	日上集团	630,698.00	6.30
575	002440	闰土股份	630,593.00	6.30
576	002050	三花智控	629,972.00	6.29

577	002087	新野纺织	628,795.00	6.28
578	300437	清水源	627,548.00	6.27
579	603968	醋化股份	627,376.00	6.27
580	600293	三峡新材	626,632.00	6.26
581	300287	飞利信	626,632.00	6.26
582	600308	华泰股份	625,507.00	6.25
583	000703	恒逸石化	624,879.00	6.24
584	600389	江山股份	624,364.13	6.24
585	601139	深圳燃气	624,113.00	6.23
586	002548	金新农	623,669.00	6.23
587	600208	新湖中宝	623,542.00	6.23
588	002731	萃华珠宝	623,150.00	6.22
589	300472	新元科技	622,729.70	6.22
590	002541	鸿路钢构	620,907.00	6.20
591	300260	新莱应材	619,543.00	6.19
592	000911	南宁糖业	618,569.00	6.18
593	002705	新宝股份	618,509.00	6.18
594	300306	远方光电	618,219.00	6.17
595	600642	申能股份	618,111.00	6.17
596	603003	龙宇燃油	617,789.00	6.17
597	002267	陕天然气	617,322.82	6.16
598	002108	沧州明珠	616,939.00	6.16
599	300112	万讯自控	616,804.24	6.16
600	600479	千金药业	616,129.00	6.15
601	300220	金运激光	615,402.85	6.15
602	002757	南兴装备	614,575.16	6.14
603	300375	鹏翎股份	613,255.53	6.12
604	600819	耀皮玻璃	612,903.00	6.12
605	002088	鲁阳节能	612,682.00	6.12
606	603299	井神股份	612,662.00	6.12
607	601101	昊华能源	609,937.00	6.09

608	300305	裕兴股份	609,622.25	6.09
609	002101	广东鸿图	609,524.00	6.09
610	600305	恒顺醋业	609,244.00	6.08
611	600727	鲁北化工	608,520.00	6.08
612	002582	好想你	606,342.87	6.06
613	300082	奥克股份	605,596.00	6.05
614	300235	方直科技	604,865.00	6.04
615	002315	焦点科技	603,532.80	6.03
616	600239	云南城投	603,191.00	6.02
617	600721	百花村	602,893.00	6.02
618	002336	人人乐	601,246.00	6.00
619	300081	恒信东方	600,529.30	6.00
620	000069	华侨城 A	598,762.00	5.98
621	000090	天健集团	598,228.70	5.97
622	300277	海联讯	596,914.48	5.96
623	603936	博敏电子	596,662.00	5.96
624	603618	杭电股份	592,728.00	5.92
625	600546	山煤国际	591,624.00	5.91
626	002671	龙泉股份	590,329.00	5.90
627	600439	瑞贝卡	590,157.00	5.89
628	600850	华东电脑	589,995.00	5.89
629	000620	新华联	588,978.00	5.88
630	000731	四川美丰	587,112.00	5.86
631	000862	银星能源	581,215.20	5.80
632	000856	冀东装备	564,685.00	5.64
633	002527	新时达	564,252.00	5.63
634	300271	华宇软件	559,251.00	5.58
635	000006	深振业 A	554,666.00	5.54
636	600123	兰花科创	542,671.00	5.42
637	600403	*ST大有	535,848.30	5.35
638	002717	岭南园林	517,472.47	5.17

639	000987	越秀金控	509,248.00	5.09
640	000552	靖远煤电	504,940.00	5.04
641	002378	章源钨业	495,264.00	4.95
642	600297	广汇汽车	481,454.00	4.81
643	002581	未名医药	474,234.00	4.74
644	300274	阳光电源	463,250.00	4.63
645	601886	江河集团	457,762.00	4.57
646	600291	西水股份	449,242.00	4.49
647	002507	涪陵榨菜	449,018.40	4.48
648	300125	易世达	446,453.00	4.46
649	000929	兰州黄河	436,840.00	4.36
650	300357	我武生物	432,637.00	4.32
651	002501	利源精制	431,610.00	4.31
652	600287	江苏舜天	430,979.00	4.30
653	002644	佛慈制药	424,478.00	4.24
654	000837	秦川机床	422,535.00	4.22
655	002078	太阳纸业	414,645.00	4.14
656	600965	福成股份	407,995.70	4.07
657	300460	惠伦晶体	399,843.50	3.99
658	600997	开滦股份	399,637.00	3.99
659	002349	精华制药	394,343.00	3.94
660	002776	柏堡龙	391,377.00	3.91
661	600874	创业环保	378,505.00	3.78
662	601222	林洋能源	377,862.13	3.77
663	600238	海南椰岛	366,060.68	3.66
664	002463	沪电股份	365,430.00	3.65
665	600110	诺德股份	351,194.50	3.51
666	600684	珠江实业	342,194.35	3.42
667	000016	深康佳 A	340,766.00	3.40
668	000028	国药一致	338,007.00	3.38
669	600585	海螺水泥	336,957.00	3.36

670	603799	华友钴业	320,083.00	3.20
671	600808	马钢股份	319,461.00	3.19
672	300142	沃森生物	313,080.00	3.13
673	600219	南山铝业	301,866.00	3.01
674	601007	金陵饭店	301,402.00	3.01
675	601137	博威合金	293,166.00	2.93
676	000818	方大化工	287,839.99	2.87
677	000415	渤海金控	287,689.00	2.87
678	000059	华锦股份	281,484.00	2.81
679	000426	兴业矿业	244,010.00	2.44
680	603168	莎普爱思	228,536.00	2.28
681	600688	上海石化	228,222.00	2.28
682	002033	丽江旅游	219,441.00	2.19
683	601668	中国建筑	215,800.00	2.16
684	002666	德联集团	215,440.91	2.15
685	600401	*ST海润	205,492.00	2.05
686	300094	国联水产	202,025.00	2.02
687	600490	鹏欣资源	201,107.00	2.01

注:本期累计买入金额按买卖成交金额,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	000046	泛海控股	8,495,984.40	84.84
2	601567	三星医疗	6,552,154.87	65.43
3	600713	南京医药	6,438,374.72	64.29
4	300339	润和软件	6,393,553.42	63.85
5	002511	中顺洁柔	5,880,455.83	58.72
6	002441	众业达	5,874,976.34	58.67
7	600711	盛屯矿业	5,772,816.00	57.65



8	002380	科远股份	5,571,448.60	55.64
9	300248	新开普	5,391,493.92	53.84
10	600028	中国石化	5,261,759.00	52.54
11	300312	邦讯技术	5,237,064.00	52.30
12	600515	海航基础	5,176,330.31	51.69
13	002093	国脉科技	5,110,599.28	51.04
14	600090	同济堂	5,035,475.65	50.29
15	600530	交大昂立	5,033,962.00	50.27
16	000761	本钢板材	5,002,930.69	49.96
17	601339	百隆东方	4,946,566.05	49.40
18	002712	思美传媒	4,933,081.12	49.26
19	000936	华西股份	4,912,185.00	49.05
20	002546	新联电子	4,795,023.60	47.88
21	002608	江苏国信	4,744,577.00	47.38
22	601636	旗滨集团	4,696,311.11	46.90
23	000676	智度股份	4,655,247.50	46.49
24	600269	赣粤高速	4,584,353.97	45.78
25	300451	创业软件	4,580,824.97	45.75
26	601877	正泰电器	4,536,937.04	45.31
27	601368	绿城水务	4,224,261.47	42.18
28	002737	葵花药业	4,124,894.27	41.19
29	600486	扬农化工	4,093,057.00	40.87
30	300130	新国都	4,087,386.36	40.82
31	002519	银河电子	4,068,288.64	40.63
32	000070	特发信息	4,060,305.30	40.55
33	600990	四创电子	4,054,110.09	40.49
34	000591	太阳能	4,048,493.96	40.43
35	000899	赣能股份	4,038,496.35	40.33
36	600589	广东榕泰	4,009,220.00	40.04
37	300064	豫金刚石	3,997,451.00	39.92
38	600982	宁波热电	3,964,000.00	39.59

39	002469	三维工程	3,955,119.90	39.50
40	600548	深高速	3,940,557.96	39.35
41	600168	武汉控股	3,935,257.56	39.30
42	603599	广信股份	3,932,352.01	39.27
43	000404	华意压缩	3,906,776.47	39.01
44	002636	金安国纪	3,902,169.39	38.97
45	300381	溢多利	3,895,248.00	38.90
46	002203	海亮股份	3,890,842.64	38.85
47	300184	力源信息	3,875,831.70	38.70
48	603808	歌力思	3,865,226.80	38.60
49	002313	日海通讯	3,811,149.00	38.06
50	002309	中利集团	3,790,228.86	37.85
51	002626	金达威	3,784,800.53	37.80
52	600499	科达洁能	3,781,791.80	37.77
53	600986	科达股份	3,741,012.74	37.36
54	002425	凯撒文化	3,734,614.60	37.29
55	002445	中南文化	3,721,226.00	37.16
56	600470	六国化工	3,701,506.00	36.96
57	002777	久远银海	3,678,465.72	36.73
58	002147	新光圆成	3,672,317.00	36.67
59	000043	中航地产	3,644,818.08	36.40
60	000782	美达股份	3,641,898.00	36.37
61	600261	阳光照明	3,637,624.00	36.33
62	600845	宝信软件	3,617,245.95	36.12
63	300494	盛天网络	3,615,003.75	36.10
64	600167	联美控股	3,575,867.00	35.71
65	002531	天顺风能	3,573,906.37	35.69
66	002228	合兴包装	3,543,651.00	35.39
67	002484	江海股份	3,543,496.24	35.39
68	000601	韶能股份	3,515,385.98	35.11
69	600395	盘江股份	3,496,365.62	34.92

70	002781	奇信股份	3,460,040.00	34.55
71	300366	创意信息	3,456,958.32	34.52
72	600382	广东明珠	3,424,331.00	34.20
73	002062	宏润建设	3,414,146.79	34.09
74	002369	卓翼科技	3,412,849.20	34.08
75	000564	供销大集	3,408,896.65	34.04
76	600218	全柴动力	3,405,029.03	34.00
77	002080	中材科技	3,398,139.00	33.93
78	002338	奥普光电	3,392,003.60	33.87
79	300373	扬杰科技	3,389,905.14	33.85
80	000959	首钢股份	3,376,800.86	33.72
81	600742	一汽富维	3,359,082.00	33.54
82	600420	现代制药	3,350,357.68	33.46
83	600114	东睦股份	3,297,803.00	32.93
84	600052	浙江广厦	3,259,175.34	32.55
85	300102	乾照光电	3,211,708.00	32.07
86	000951	中国重汽	3,185,251.80	31.81
87	002121	科陆电子	3,138,776.00	31.34
88	002449	国星光电	3,126,854.00	31.23
89	300419	浩丰科技	3,100,028.00	30.96
90	601799	星宇股份	3,047,688.89	30.43
91	603686	龙马环卫	3,019,188.99	30.15
92	300303	聚飞光电	3,011,419.02	30.07
93	300050	世纪鼎利	3,008,728.67	30.05
94	000525	红太阳	2,969,735.00	29.66
95	300456	耐威科技	2,943,951.00	29.40
96	600255	鑫科材料	2,889,524.00	28.86
97	300360	炬华科技	2,889,434.00	28.85
98	603017	中衡设计	2,860,522.25	28.57
99	000813	德展健康	2,845,789.34	28.42
100	600409	三友化工	2,837,400.00	28.33

101	300279	和晶科技	2,817,994.67	28.14
102	000055	方大集团	2,789,438.00	27.86
103	002421	达实智能	2,784,797.88	27.81
104	002683	宏大爆破	2,755,053.75	27.51
105	002064	华峰氨纶	2,753,490.00	27.50
106	300228	富瑞特装	2,728,131.60	27.24
107	002100	天康生物	2,668,568.76	26.65
108	002296	辉煌科技	2,668,052.00	26.64
109	002322	理工环科	2,661,898.84	26.58
110	002102	冠福股份	2,647,518.00	26.44
111	603368	柳州医药	2,635,153.00	26.32
112	603128	华贸物流	2,605,929.50	26.02
113	002435	长江润发	2,599,613.65	25.96
114	300193	佳士科技	2,592,683.00	25.89
115	600562	国睿科技	2,572,545.00	25.69
116	000898	鞍钢股份	2,548,407.00	25.45
117	300297	蓝盾股份	2,527,732.96	25.24
118	002528	英飞拓	2,526,795.20	25.23
119	000518	四环生物	2,524,037.76	25.21
120	600603	广汇物流	2,522,341.89	25.19
121	002171	楚江新材	2,513,939.00	25.10
122	600077	宋都股份	2,483,858.00	24.80
123	603118	共进股份	2,454,834.00	24.51
124	600676	交运股份	2,453,535.00	24.50
125	300031	宝通科技	2,448,801.00	24.45
126	300307	慈星股份	2,443,625.75	24.40
127	603996	中新科技	2,441,336.50	24.38
128	002429	兆驰股份	2,426,628.00	24.23
129	600438	通威股份	2,388,573.08	23.85
130	600508	上海能源	2,377,530.00	23.74
131	000688	建新矿业	2,368,960.00	23.66

132	300047	天源迪科	2,368,115.35	23.65
133	000932	*ST华菱	2,353,189.00	23.50
134	600527	江南高纤	2,323,402.00	23.20
135	603609	禾丰牧业	2,320,750.50	23.18
136	600667	太极实业	2,305,132.00	23.02
137	002288	超华科技	2,286,512.00	22.83
138	300054	鼎龙股份	2,283,732.00	22.81
139	600185	格力地产	2,273,271.80	22.70
140	000901	航天科技	2,259,314.00	22.56
141	002604	龙力生物	2,256,630.00	22.54
142	600730	中国高科	2,249,117.02	22.46
143	002370	亚太药业	2,242,600.79	22.40
144	300269	联建光电	2,239,478.00	22.36
145	300317	珈伟股份	2,230,353.84	22.27
146	300071	华谊嘉信	2,186,019.53	21.83
147	002630	华西能源	2,183,183.00	21.80
148	000042	中洲控股	2,160,910.44	21.58
149	600094	大名城	2,158,867.00	21.56
150	601700	风范股份	2,145,698.00	21.43
151	600775	南京熊猫	2,143,425.00	21.40
152	002094	青岛金王	2,137,627.21	21.35
153	600191	华资实业	2,125,366.00	21.22
154	600075	新疆天业	2,121,660.70	21.19
155	300204	舒泰神	2,121,247.45	21.18
156	002020	京新药业	2,120,407.49	21.17
157	601616	广电电气	2,119,568.74	21.17
158	300232	洲明科技	2,119,158.00	21.16
159	600229	城市传媒	2,111,679.40	21.09
160	600346	恒力股份	2,110,926.44	21.08
161	600756	浪潮软件	2,108,435.00	21.06
162	300008	天海防务	2,057,406.68	20.55

163	002667	鞍重股份	2,022,620.00	20.20
164	600310	桂东电力	2,018,795.00	20.16
165	600661	新南洋	2,016,363.00	20.14
166	300318	博晖创新	2,012,634.79	20.10
167	002481	双塔食品	2,003,256.00	20.00
168	002039	黔源电力	1,996,572.55	19.94
169	300189	神农基因	1,991,294.00	19.89
170	300349	金卡智能	1,982,725.00	19.80
171	300316	晶盛机电	1,980,342.00	19.78
172	000551	创元科技	1,977,605.84	19.75
173	002109	兴化股份	1,965,028.00	19.62
174	002021	中捷资源	1,964,753.00	19.62
175	002529	海源机械	1,950,806.00	19.48
176	300468	四方精创	1,946,375.00	19.44
177	002224	三力士	1,932,870.00	19.30
178	000700	模塑科技	1,924,836.00	19.22
179	603828	柯利达	1,924,432.84	19.22
180	002037	久联发展	1,923,114.08	19.20
181	000058	深赛格	1,919,319.00	19.17
182	300048	合康新能	1,908,370.00	19.06
183	000739	普洛药业	1,887,239.75	18.85
184	300083	劲胜智能	1,881,901.97	18.79
185	600273	嘉化能源	1,875,209.00	18.73
186	002090	金智科技	1,868,302.78	18.66
187	000850	华茂股份	1,857,713.00	18.55
188	002624	完美世界	1,853,795.12	18.51
189	000948	南天信息	1,852,642.96	18.50
190	600105	永鼎股份	1,851,748.68	18.49
191	600879	航天电子	1,844,563.53	18.42
192	300123	太阳鸟	1,839,886.12	18.37
193	600745	中茵股份	1,839,305.00	18.37

194	600377	宁沪高速	1,839,150.00	18.37
195	300190	维尔利	1,833,035.47	18.31
196	601388	怡球资源	1,825,970.00	18.23
197	002521	齐峰新材	1,822,571.00	18.20
198	002662	京威股份	1,817,404.00	18.15
199	300041	回天新材	1,813,750.00	18.11
200	300439	美康生物	1,812,788.26	18.10
201	002763	汇洁股份	1,804,054.52	18.02
202	002432	九安医疗	1,788,686.00	17.86
203	300171	东富龙	1,787,865.54	17.85
204	000705	浙江震元	1,783,762.49	17.81
205	300162	雷曼股份	1,781,752.00	17.79
206	300485	赛升药业	1,780,949.00	17.78
207	600278	东方创业	1,779,941.00	17.77
208	300195	长荣股份	1,774,209.00	17.72
209	002609	捷顺科技	1,769,450.00	17.67
210	600162	香江控股	1,768,619.75	17.66
211	300165	天瑞仪器	1,761,039.00	17.59
212	600429	三元股份	1,756,519.00	17.54
213	002518	科士达	1,746,030.00	17.44
214	300342	天银机电	1,734,908.97	17.33
215	603018	中设集团	1,716,381.96	17.14
216	002148	北纬通信	1,715,738.66	17.13
217	002372	伟星新材	1,713,150.00	17.11
218	002775	文科园林	1,712,499.00	17.10
219	000910	大亚圣象	1,703,457.62	17.01
220	002766	索菱股份	1,681,406.40	16.79
221	600526	菲达环保	1,672,471.00	16.70
222	600172	黄河旋风	1,667,243.77	16.65
223	002545	东方铁塔	1,666,918.70	16.65
224	600502	安徽水利	1,650,489.00	16.48

225	600035	楚天高速	1,639,805.00	16.38
226	600963	岳阳林纸	1,622,731.00	16.20
227	002454	松芝股份	1,617,766.72	16.16
228	002612	朗姿股份	1,613,143.64	16.11
229	002144	宏达高科	1,607,001.00	16.05
230	600885	宏发股份	1,602,963.00	16.01
231	600862	中航高科	1,594,578.13	15.92
232	300323	华灿光电	1,592,597.00	15.90
233	002411	必康股份	1,582,916.00	15.81
234	002376	新北洋	1,553,848.00	15.52
235	002497	雅化集团	1,537,649.00	15.36
236	600323	瀚蓝环境	1,529,415.96	15.27
237	600771	广誉远	1,527,799.23	15.26
238	600728	佳都科技	1,521,895.00	15.20
239	002771	真视通	1,509,830.00	15.08
240	300310	宜通世纪	1,508,452.52	15.06
241	000795	英洛华	1,501,622.00	15.00
242	601058	赛轮金宇	1,444,448.00	14.42
243	000036	华联控股	1,441,610.44	14.40
244	600363	联创光电	1,429,897.88	14.28
245	000807	云铝股份	1,428,347.63	14.26
246	002583	海能达	1,425,886.00	14.24
247	603566	普莱柯	1,420,427.00	14.18
248	600033	福建高速	1,418,982.00	14.17
249	600461	洪城水业	1,418,556.00	14.17
250	002559	亚威股份	1,415,234.00	14.13
251	300068	南都电源	1,406,292.00	14.04
252	600613	神奇制药	1,401,042.06	13.99
253	002433	太安堂	1,386,174.00	13.84
254	002003	伟星股份	1,374,820.68	13.73
255	601225	陕西煤业	1,366,811.00	13.65



256	000657	中钨高新	1,363,258.00	13.61
257	600744	华银电力	1,360,153.00	13.58
258	000637	茂化实华	1,351,186.00	13.49
259	600622	嘉宝集团	1,342,750.70	13.41
260	002393	力生制药	1,331,929.00	13.30
261	000429	粤高速 A	1,328,479.36	13.27
262	002212	南洋股份	1,316,881.00	13.15
263	300158	振东制药	1,313,794.00	13.12
264	600188	兖州煤业	1,309,878.68	13.08
265	600093	易见股份	1,301,347.00	13.00
266	000065	北方国际	1,292,555.50	12.91
267	300285	国瓷材料	1,283,517.00	12.82
268	300040	九洲电气	1,280,752.56	12.79
269	000732	泰禾集团	1,279,042.04	12.77
270	002392	北京利尔	1,276,881.00	12.75
271	600677	航天通信	1,275,925.16	12.74
272	002427	尤夫股份	1,263,017.00	12.61
273	002434	万里扬	1,260,703.00	12.59
274	002462	嘉事堂	1,257,012.00	12.55
275	002023	海特高新	1,254,126.00	12.52
276	600057	象屿股份	1,253,836.00	12.52
277	603898	好莱客	1,244,079.17	12.42
278	600211	西藏药业	1,236,221.00	12.35
279	000030	富奥股份	1,232,624.72	12.31
280	300138	晨光生物	1,229,440.57	12.28
281	002617	露笑科技	1,226,574.00	12.25
282	002334	英威腾	1,221,261.00	12.20
283	002156	通富微电	1,219,795.94	12.18
284	600190	锦州港	1,217,019.00	12.15
285	002686	亿利达	1,207,541.00	12.06
286	000796	凯撒旅游	1,207,134.00	12.05

287	002597	金禾实业	1,205,739.00	12.04
288	600595	中孚实业	1,204,059.00	12.02
289	002452	长高集团	1,201,063.00	11.99
290	300237	美晨科技	1,199,128.85	11.97
291	000553	沙隆达 A	1,196,785.00	11.95
292	002387	黑牛食品	1,192,110.00	11.90
293	600405	动力源	1,187,812.70	11.86
294	000767	漳泽电力	1,178,910.50	11.77
295	300284	苏交科	1,177,383.00	11.76
296	002218	拓日新能	1,176,339.00	11.75
297	300157	恒泰艾普	1,171,093.00	11.69
298	002448	中原内配	1,168,822.00	11.67
299	601599	鹿港文化	1,158,288.00	11.57
300	601566	九牧王	1,155,320.00	11.54
301	000545	金浦钛业	1,155,228.37	11.54
302	600396	金山股份	1,153,622.00	11.52
303	600866	星湖科技	1,148,522.00	11.47
304	000733	振华科技	1,148,036.00	11.46
305	000811	烟台冰轮	1,144,065.00	11.42
306	603338	浙江鼎力	1,142,894.46	11.41
307	300224	正海磁材	1,141,847.00	11.40
308	000915	山大华特	1,141,649.35	11.40
309	002060	粤水电	1,140,815.00	11.39
310	600126	杭钢股份	1,139,614.14	11.38
311	000790	泰合健康	1,139,341.00	11.38
312	600683	京投发展	1,138,947.16	11.37
313	002567	唐人神	1,135,116.00	11.34
314	002126	银轮股份	1,134,404.00	11.33
315	600063	皖维高新	1,132,599.00	11.31
316	002468	申通快递	1,127,069.00	11.26
317	300241	瑞丰光电	1,126,893.00	11.25

318	601218	吉鑫科技	1,113,993.40	11.12
319	002298	中电鑫龙	1,113,939.00	11.12
320	300118	东方日升	1,106,689.40	11.05
321	000040	东旭蓝天	1,105,717.00	11.04
322	002235	安妮股份	1,105,427.00	11.04
323	601107	四川成渝	1,101,006.00	10.99
324	000096	广聚能源	1,091,296.00	10.90
325	300038	梅泰诺	1,090,294.54	10.89
326	000863	三湘印象	1,089,331.00	10.88
327	300183	东软载波	1,082,080.16	10.81
328	000561	烽火电子	1,069,557.56	10.68
329	300214	日科化学	1,067,252.00	10.66
330	002188	巴士在线	1,064,240.00	10.63
331	002446	盛路通信	1,060,210.00	10.59
332	300053	欧比特	1,059,818.94	10.58
333	002139	拓邦股份	1,059,474.00	10.58
334	600552	凯盛科技	1,051,808.26	10.50
335	002502	骅威文化	1,051,022.00	10.50
336	300049	福瑞股份	1,049,805.12	10.48
337	002097	山河智能	1,049,013.00	10.48
338	002314	南山控股	1,047,004.00	10.46
339	002103	广博股份	1,044,778.00	10.43
340	002182	云海金属	1,034,891.00	10.33
341	300495	美尚生态	1,031,569.80	10.30
342	002259	升达林业	1,029,635.00	10.28
343	002086	东方海洋	1,027,919.00	10.26
344	002111	威海广泰	1,022,736.70	10.21
345	002279	久其软件	1,019,722.00	10.18
346	000971	高升控股	1,016,368.63	10.15
347	300004	南风股份	1,013,057.88	10.12
348	300255	常山药业	1,011,706.00	10.10

349	000701	厦门信达	1,010,694.00	10.09
350	603600	永艺股份	1,008,609.00	10.07
351	000886	海南高速	1,007,453.00	10.06
352	002483	润邦股份	1,006,286.00	10.05
353	300143	星普医科	1,004,985.07	10.04
354	002256	兆新股份	1,000,082.00	9.99
355	300256	星星科技	999,159.21	9.98
356	600846	同济科技	991,501.42	9.90
357	603818	曲美家居	989,794.13	9.88
358	300337	银邦股份	984,907.12	9.84
359	300074	华平股份	984,498.00	9.83
360	002619	巨龙管业	983,598.00	9.82
361	002648	卫星石化	981,870.90	9.81
362	002383	合众思壮	977,964.26	9.77
363	002540	亚太科技	976,449.00	9.75
364	000537	广宇发展	975,501.00	9.74
365	600590	泰豪科技	972,105.00	9.71
366	002543	万和电气	971,388.00	9.70
367	002274	华昌化工	969,844.22	9.69
368	600206	有研新材	968,633.00	9.67
369	600658	电子城	967,981.99	9.67
370	300018	中元股份	967,300.00	9.66
371	603939	益丰药房	965,231.00	9.64
372	603008	喜临门	964,631.00	9.63
373	300298	三诺生物	961,549.90	9.60
374	300151	昌红科技	961,104.21	9.60
375	600531	豫光金铅	956,455.00	9.55
376	002079	苏州固锴	953,863.00	9.53
377	300229	拓尔思	953,531.00	9.52
378	002324	普利特	948,951.61	9.48
379	002574	明牌珠宝	948,146.00	9.47

380	600708	光明地产	945,510.00	9.44
381	000665	湖北广电	942,274.90	9.41
382	002438	江苏神通	939,835.70	9.39
383	300309	吉艾科技	932,140.00	9.31
384	002135	东南网架	930,270.00	9.29
385	002713	东易日盛	929,299.00	9.28
386	300356	光一科技	928,220.38	9.27
387	300140	中环装备	927,842.95	9.27
388	002286	保龄宝	927,384.00	9.26
389	300328	宜安科技	926,345.00	9.25
390	300353	东土科技	922,770.00	9.21
391	002520	日发精机	922,289.66	9.21
392	002586	围海股份	922,166.00	9.21
393	002232	启明信息	921,653.40	9.20
394	600726	华电能源	920,984.00	9.20
395	000546	金圆股份	905,491.00	9.04
396	300358	楚天科技	905,090.54	9.04
397	002337	赛象科技	904,785.26	9.04
398	002783	凯龙股份	898,318.00	8.97
399	600501	航天晨光	897,806.00	8.97
400	300155	安居宝	897,201.00	8.96
401	300444	双杰电气	896,535.00	8.95
402	601199	江南水务	895,957.00	8.95
403	300139	晓程科技	890,864.00	8.90
404	600136	当代明诚	884,642.24	8.83
405	002472	双环传动	884,325.69	8.83
406	002457	青龙管业	882,970.66	8.82
407	000531	穗恒运 A	882,873.00	8.82
408	300365	恒华科技	877,040.44	8.76
409	603012	创力集团	875,759.00	8.75
410	300438	鹏辉能源	873,832.75	8.73

411	600246	万通地产	873,311.00	8.72
412	603100	川仪股份	872,026.00	8.71
413	600629	华建集团	868,284.58	8.67
414	002592	八菱科技	865,986.74	8.65
415	300177	中海达	863,858.84	8.63
416	000589	黔轮胎 A	863,592.63	8.62
417	002115	三维通信	858,437.99	8.57
418	002197	证通电子	858,264.34	8.57
419	300254	仟源医药	854,577.00	8.53
420	002114	罗平锌电	851,191.00	8.50
421	000038	深大通	846,366.00	8.45
422	600864	哈投股份	845,241.00	8.44
423	600550	保变电气	834,543.00	8.33
424	300508	维宏股份	827,431.00	8.26
425	300384	三联虹普	825,308.00	8.24
426	600335	国机汽车	823,535.26	8.22
427	300389	艾比森	822,762.44	8.22
428	300448	浩云科技	816,906.00	8.16
429	603567	珍宝岛	815,659.00	8.15
430	002750	龙津药业	804,114.00	8.03
431	000023	深天地 A	802,795.22	8.02
432	002504	*ST弘高	799,959.00	7.99
433	600210	紫江企业	794,521.00	7.93
434	300484	蓝海华腾	792,586.00	7.91
435	300293	蓝英装备	791,618.00	7.91
436	600685	中船防务	772,987.22	7.72
437	600054	黄山旅游	772,226.91	7.71
438	600738	兰州民百	770,229.96	7.69
439	300399	京天利	761,674.95	7.61
440	600792	云煤能源	760,516.00	7.59
441	002146	荣盛发展	759,938.00	7.59

442	000965	天保基建	758,843.00	7.58
443	600186	莲花健康	758,109.00	7.57
444	600345	长江通信	757,746.00	7.57
445	300512	中亚股份	757,280.00	7.56
446	603788	宁波高发	751,861.29	7.51
447	000498	山东路桥	748,017.00	7.47
448	002514	宝馨科技	746,501.00	7.45
449	600128	弘业股份	746,456.87	7.45
450	601088	中国神华	743,456.00	7.42
451	002056	横店东磁	738,125.00	7.37
452	603588	高能环境	735,744.15	7.35
453	002534	杭锅股份	733,820.00	7.33
454	002362	汉王科技	732,211.00	7.31
455	002258	利尔化学	729,801.00	7.29
456	300246	宝莱特	728,639.00	7.28
457	600175	美都能源	723,904.00	7.23
458	300507	苏奥传感	719,263.00	7.18
459	600825	新华传媒	718,897.00	7.18
460	600600	青岛啤酒	717,987.02	7.17
461	600602	云赛智联	713,924.28	7.13
462	002054	德美化工	711,179.00	7.10
463	600203	福日电子	709,302.72	7.08
464	002050	三花智控	708,244.00	7.07
465	300395	菲利华	703,373.78	7.02
466	600782	新钢股份	701,643.00	7.01
467	000570	苏常柴 A	699,279.00	6.98
468	603737	三棵树	696,506.00	6.96
469	000880	潍柴重机	695,499.14	6.95
470	601038	一拖股份	693,905.00	6.93
471	600383	金地集团	693,310.00	6.92
472	000662	天夏智慧	691,943.63	6.91

473	600748	上实发展	691,424.60	6.90
474	300519	新光药业	689,896.00	6.89
475	002496	辉丰股份	689,182.00	6.88
476	300407	凯发电气	687,043.00	6.86
477	300511	雪榕生物	685,503.00	6.85
478	600569	安阳钢铁	684,804.00	6.84
479	600208	新湖中宝	683,574.00	6.83
480	600653	申华控股	682,377.00	6.81
481	002661	克明面业	681,173.00	6.80
482	600664	哈药股份	679,276.42	6.78
483	300252	金信诺	676,153.00	6.75
484	600872	中炬高新	675,478.00	6.75
485	600573	惠泉啤酒	674,673.00	6.74
486	002615	哈尔斯	672,861.00	6.72
487	300525	博思软件	670,670.85	6.70
488	300082	奥克股份	669,096.00	6.68
489	603116	红蜻蜓	667,934.00	6.67
490	300522	世名科技	666,743.00	6.66
491	002535	林州重机	666,051.00	6.65
492	600755	厦门国贸	664,605.00	6.64
493	002705	新宝股份	664,382.00	6.63
494	002523	天桥起重	664,216.00	6.63
495	600512	腾达建设	663,652.00	6.63
496	603936	博敏电子	662,657.00	6.62
497	600350	山东高速	661,815.00	6.61
498	000069	华侨城 A	661,102.00	6.60
499	300067	安诺其	660,294.00	6.59
500	002181	粤传媒	658,400.00	6.57
501	600546	山煤国际	655,271.00	6.54
502	002607	亚夏汽车	653,763.20	6.53
503	300235	方直科技	653,757.00	6.53



504	002336	人人乐	653,604.00	6.53
505	300112	万讯自控	653,456.41	6.53
506	002536	西泵股份	652,924.00	6.52
507	000949	新乡化纤	650,380.00	6.49
508	000021	深科技	650,222.00	6.49
509	000090	天健集团	650,059.58	6.49
510	600812	华北制药	649,961.50	6.49
511	300260	新莱应材	648,514.00	6.48
512	002480	新筑股份	646,431.00	6.46
513	603166	福达股份	644,343.89	6.43
514	300220	金运激光	643,681.00	6.43
515	300375	鹏翎股份	643,535.00	6.43
516	000938	紫光股份	642,492.00	6.42
517	002802	洪汇新材	642,465.00	6.42
518	002768	国恩股份	641,201.00	6.40
519	600597	光明乳业	640,602.00	6.40
520	600020	中原高速	639,151.00	6.38
521	002013	中航机电	638,037.00	6.37
522	300108	双龙股份	636,969.00	6.36
523	300462	华铭智能	635,383.00	6.35
524	002482	广田集团	635,257.00	6.34
525	300472	新元科技	634,690.00	6.34
526	300081	恒信东方	633,763.00	6.33
527	600133	东湖高新	633,209.00	6.32
528	002398	建研集团	633,180.00	6.32
529	002757	南兴装备	631,809.00	6.31
530	002731	萃华珠宝	631,031.00	6.30
531	600091	ST明科	630,952.00	6.30
532	600727	鲁北化工	630,272.00	6.29
533	002238	天威视讯	629,038.20	6.28
534	002382	蓝帆医疗	628,919.00	6.28

535	002151	北斗星通	627,311.95	6.26
536	600479	千金药业	627,180.00	6.26
537	002150	通润装备	627,100.00	6.26
538	603968	醋化股份	626,914.00	6.26
539	600305	恒顺醋业	626,840.00	6.26
540	600239	云南城投	625,855.10	6.25
541	002088	鲁阳节能	625,553.00	6.25
542	002315	焦点科技	624,497.00	6.24
543	601139	深圳燃气	622,862.00	6.22
544	600389	江山股份	622,725.00	6.22
545	002420	毅昌股份	621,716.00	6.21
546	603366	日出东方	621,638.00	6.21
547	002077	大港股份	620,772.68	6.20
548	600529	山东药玻	620,478.96	6.20
549	300121	阳谷华泰	619,904.72	6.19
550	601313	江南嘉捷	619,127.00	6.18
551	000627	天茂集团	617,804.00	6.17
552	600831	广电网络	616,367.00	6.16
553	002190	成飞集成	616,357.00	6.16
554	600894	广日股份	615,899.00	6.15
555	002350	北京科锐	614,555.94	6.14
556	300277	海联讯	610,589.00	6.10
557	600426	华鲁恒升	609,823.00	6.09
558	002493	荣盛石化	609,207.00	6.08
559	002108	沧州明珠	608,761.00	6.08
560	300305	裕兴股份	608,191.00	6.07
561	002671	龙泉股份	603,275.00	6.02
562	000856	冀东装备	602,610.00	6.02
563	000628	高新发展	601,518.58	6.01
564	002165	红宝丽	601,067.00	6.00
565	000731	四川美丰	598,870.00	5.98

566	600293	三峡新材	597,593.74	5.97
567	000703	恒逸石化	597,366.00	5.97
568	002563	森马服饰	597,137.00	5.96
569	000862	银星能源	594,231.00	5.93
570	600235	民丰特纸	594,012.20	5.93
571	002160	常铝股份	592,505.00	5.92
572	002295	精艺股份	592,030.00	5.91
573	600642	申能股份	591,518.00	5.91
574	600757	长江传媒	590,811.81	5.90
575	600850	华东电脑	589,740.00	5.89
576	002637	赞宇科技	585,664.34	5.85
577	601101	昊华能源	584,568.54	5.84
578	002717	岭南园林	582,303.00	5.81
579	603299	井神股份	580,684.00	5.80
580	300287	飞利信	579,448.00	5.79
581	002440	闰土股份	576,559.00	5.76
582	603618	杭电股份	576,397.00	5.76
583	002210	飞马国际	573,673.56	5.73
584	600960	渤海活塞	571,010.00	5.70
585	603003	龙宇燃油	570,513.00	5.70
586	300391	康跃科技	569,577.57	5.69
587	002527	新时达	569,439.00	5.69
588	002101	广东鸿图	568,922.00	5.68
589	002378	章源钨业	568,612.00	5.68
590	300306	远方光电	568,361.25	5.68
591	300282	汇冠股份	567,753.00	5.67
592	002582	好想你	565,953.80	5.65
593	002087	新野纺织	563,390.00	5.63
594	600874	创业环保	563,083.00	5.62
595	603958	哈森股份	560,715.00	5.60
596	000911	南宁糖业	560,535.00	5.60

597	002267	陕天然气	558,759.00	5.58
598	600969	郴电国际	558,232.00	5.57
599	600721	百花村	557,981.00	5.57
600	002548	金新农	555,355.00	5.55
601	300509	新美星	553,809.00	5.53
602	600308	华泰股份	552,994.00	5.52
603	002778	高科石化	548,159.00	5.47
604	300515	三德科技	544,417.00	5.44
605	000620	新华联	541,521.00	5.41
606	000006	深振业 A	541,358.00	5.41
607	300437	清水源	539,869.00	5.39
608	002541	鸿路钢构	539,716.17	5.39
609	600439	瑞贝卡	525,084.14	5.24
610	600819	耀皮玻璃	512,852.00	5.12
611	002593	日上集团	512,548.00	5.12
612	600123	兰花科创	508,887.00	5.08
613	000990	诚志股份	503,168.00	5.02
614	600302	标准股份	501,347.34	5.01
615	002537	海立美达	498,362.80	4.98
616	002091	江苏国泰	495,120.00	4.94
617	000552	靖远煤电	490,538.00	4.90
618	600403	*ST大有	489,991.70	4.89
619	002507	涪陵榨菜	479,543.13	4.79
620	002581	未名医药	476,073.00	4.75
621	300274	阳光电源	468,721.74	4.68
622	002501	利源精制	462,535.00	4.62
623	002247	帝龙文化	461,895.00	4.61
624	000929	兰州黄河	456,619.00	4.56
625	000987	越秀金控	453,825.00	4.53
626	600291	西水股份	445,712.00	4.45
627	601886	江河集团	442,531.99	4.42

628	600567	山鹰纸业	439,491.00	4.39
629	002349	精华制药	429,879.00	4.29
630	002644	佛慈制药	420,308.00	4.20
631	600965	福成股份	413,580.00	4.13
632	300460	惠伦晶体	413,545.00	4.13
633	300357	我武生物	410,060.54	4.09
634	600287	江苏舜天	408,926.00	4.08
635	002463	沪电股份	406,801.00	4.06
636	002078	太阳纸业	402,789.00	4.02
637	300125	易世达	402,644.00	4.02
638	002776	柏堡龙	390,711.00	3.90
639	600238	海南椰岛	386,817.20	3.86
640	600110	诺德股份	385,734.00	3.85
641	600736	苏州高新	384,677.12	3.84
642	002226	江南化工	381,112.00	3.81
643	601222	林洋能源	376,687.60	3.76
644	002401	中远海科	371,619.00	3.71
645	600684	珠江实业	352,586.00	3.52
646	603799	华友钴业	350,939.00	3.50
647	600997	开滦股份	348,442.00	3.48
648	600585	海螺水泥	339,937.00	3.39
649	000028	国药一致	338,815.00	3.38
650	000016	深康佳 A	334,905.00	3.34
651	600641	万业企业	333,817.00	3.33
652	000818	方大化工	302,954.00	3.03
653	601137	博威合金	302,385.00	3.02
654	600219	南山铝业	301,775.00	3.01
655	300142	沃森生物	300,757.00	3.00
656	600808	马钢股份	298,329.00	2.98
657	601007	金陵饭店	297,194.00	2.97
658	000415	渤海金控	282,739.00	2.82

659	000066	中国长城	267,029.00	2.67
660	000426	兴业矿业	249,797.00	2.49
661	601668	中国建筑	247,443.00	2.47
662	000059	华锦股份	241,879.00	2.42
663	002033	丽江旅游	233,110.00	2.33
664	000837	秦川机床	229,106.00	2.29
665	600688	上海石化	228,793.00	2.28
666	603168	莎普爱思	214,187.00	2.14
667	000158	常山股份	207,238.00	2.07
668	002302	西部建设	206,259.00	2.06
669	300094	国联水产	203,233.00	2.03

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	1,241,487,957.37
卖出股票的收入（成交）总额	1,049,925,425.34

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或在编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。**

**7.12.2 本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。**

**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	87,712.97
2	应收证券清算款	2,761,010.62
3	应收股利	-
4	应收利息	2,785.29
5	应收申购款	5,545.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,857,054.78

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

## § 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( %)
创金 合信 中证1 000增 强A	104	1,973,157.96	203,777,990.55	99.30	1,430,437.10	0.70
创金 合信 中证1 000增 强C	176	37,584.88	5,000,166.66	75.59	1,614,772.40	24.41
合计	267	793,345.94	208,778,157.21	98.56	3,045,209.50	1.44

## 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	创金合信中证1000增强A	13,536.97	0.01
	创金合信中证1000增强C	8,509.35	0.13
	合计	22,046.32	0.01



## 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	创金合信中证1000增强A	0.00
	创金合信中证1000增强C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	创金合信中证1000增强A	0.00
	创金合信中证1000增强C	0.00
	合计	-

## 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	10,000,333.36	4.72	10,000,333.36	4.72	36月
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	10,000,333.36	4.72	10,000,333.36	4.72	-
----	---------------	------	---------------	------	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	创金合信中证1000增强 A	创金合信中证1000增强 C
基金合同生效日(2016年12月22日)基金份额总额	5,023,647.81	5,092,069.61
本报告期期初基金份额总额	5,022,559.69	5,106,272.27
本报告期期间基金总申购份额	200,323,128.84	2,380,043.30
减：本报告期期间基金总赎回份额	137,260.88	871,376.51
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,208,427.65	6,614,939.06

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、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

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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚等情况。

## 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	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比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信期货	1	-	0.00	-	0.00	-
金元证券	2	2,288,677,089.46	100.00	499,440.15	100.00	-
第一创业证券	2	-	0.00	-	0.00	-

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，并能提供全面的信息服。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内新增第一创业证券的2个交易单元。

### 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	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交 金额	占当期 债券成 交总量 的比例 (%)	成交 金额	占当期 债券回 购交易 成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期 权证交 易成交 总额的 比例(%) )	成交 金额	占当期 基金交 易成交 总额的 比例(%) )
中信期货	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	创金合信基金管理有限公司旗下基金资产净值公告	公司官网、证券时报	2017-01-01
2	创金合信基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式证券投资基金申购及赎回金额的公告	公司官网、证券时报	2017-01-04
3	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-01-07
4	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购公告	公司官网、证券时报	2017-01-13
5	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加蛋卷基金为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-01-24
6	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加平安证券为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-02-09
7	创金合信基金管理有限公司	公司官网、证券时报	2017-02-11

	关于旗下部分基金估值方法变更的提示性公告		
8	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-02-16
9	创金合信基金管理有限公司关于直销柜台申购费率优惠政策调整的公告	公司官网、证券时报	2017-02-22
10	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金暂停大额申购业务的公告	公司官网、证券时报	2017-03-01
11	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加上海基煜为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-03-16
12	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金增加汇成基金为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-03-24
13	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金增加大泰金石为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-04-14
14	创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	公司官网、证券时报	2017-04-21
15	创金合信基金管理有限公司旗下部分开放式证券投资基金增加安信证券为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-04-26
16	创金合信基金管理有限公司关于旗下部分开放式证券投资基金增加前海凯恩斯为代销机构的公告	公司官网、证券时报	2017-06-05

17	创金合信基金管理有限公司 关于开通旗下部分开放式基金转换业务的公告	公司官网、证券时报	2017-06-13
18	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分基金及其代销机构一览表的公告	公司官网、证券时报	2017-06-23
19	创金合信基金管理有限公司 关于旗下部分开放式基金增加代销机构暨参加代销机构费率优惠活动的公告	公司官网、证券时报	2017-06-28

## § 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 -20170105	10,000,333.36	0.00	0.00	10,000,333.36	4.72
	2	20170106 -20170630	0.00	158,930,244.65	0.00	158,930,244.65	75.03
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1、大额申购风险 在发生投资者大额申购时，若本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、大额赎回风险</p>							

- (1) 若本基金在短期内难以变现足够的资产予以应对，可能导致流动性风险；
- (2) 若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，将可能对基金管理人的管理造成影响；
- (3) 基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作；
- (4) 因基金净值精度计算问题，可能因赎回费归入基金资产，导致基金净值有较大波动；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续条件，可能导致基金合同终止、清算等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制，以有效防止上述风险，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 2、《创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 3、创金合信中证1000指数增强型发起式证券投资基金2017年半年度报告原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦15楼

### 12.3 查阅方式

www.cjhxfund.com

创金合信基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日