

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金
2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：银华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 6 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.....	6
§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.....	7
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	11
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.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	69

7.12 投资组合报告附注.....	69
§8 基金份额持有人信息.....	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	72
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
10.8 其他重大事件.....	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§12 备查文件目录.....	84
12.1 备查文件目录.....	84
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金		
基金简称	银华中证 800 等权指数增强分级		
场内简称	800 分级		
基金主代码	161825		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013 年 11 月 5 日		
基金管理人	银华基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	148,341,582.72 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2013-12-11		
下属分级基金的基金简称	中证 800A	中证 800B	800 分级
下属分级基金的交易代码	150138	150139	161825
报告期末下属分级基金份额总额	40,546,701.00 份	40,546,701.00 份	67,248,180.72 份

注：本基金管理人于 2015 年 4 月 30 日发布公告，自 2015 年 5 月 4 日起将本基金的基础份额的场内简称由“银华 800”变更为“800 分级”。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金。本基金在对中证 800 等权重指数进行有效跟踪的基础上，通过量化投资技术与基本面分析相结合的方法对目标指数进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金以中证 800 等权重指数为目标指数，在有效复制目标指数的基础上，结合量化投资技术与基本面分析对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在控制投资组合与业绩比较基准跟踪误差的基础上，力争获得超越业绩比较基准的收益。</p> <p>当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪中证 800 等权重指数的效果可能带来影响，导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。但因特殊情况（比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法（如买入非成份股等）进行适当的替代。</p> <p>本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不</p>

	低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。		
业绩比较基准	95%×中证 800 等权重指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金与混合型基金。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定。	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		银华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨文辉	王永民
	联系电话	(010)58163000	010-66594896
	电子邮箱	yhjj@yhfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4006783333, (010)85186558	95566
传真		(010)58163027	(010) 66594942
注册地址		广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 19 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市东城区东长安街 1 号 东方广场东方经贸城 C2 办公楼 15 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100738	100818
法定代表人		王珠林	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.yhfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年6月30日)
本期已实现收益	38,084,243.15
本期利润	31,470,922.08
加权平均基金份额本期利润	0.3572
本期加权平均净值利润率	31.24%
本期基金份额净值增长率	48.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	65,613,981.77
期末可供分配基金份额利润	0.4423
期末基金资产净值	127,490,213.49
期末基金份额净值	0.859
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	105.93%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：基金的认购、申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

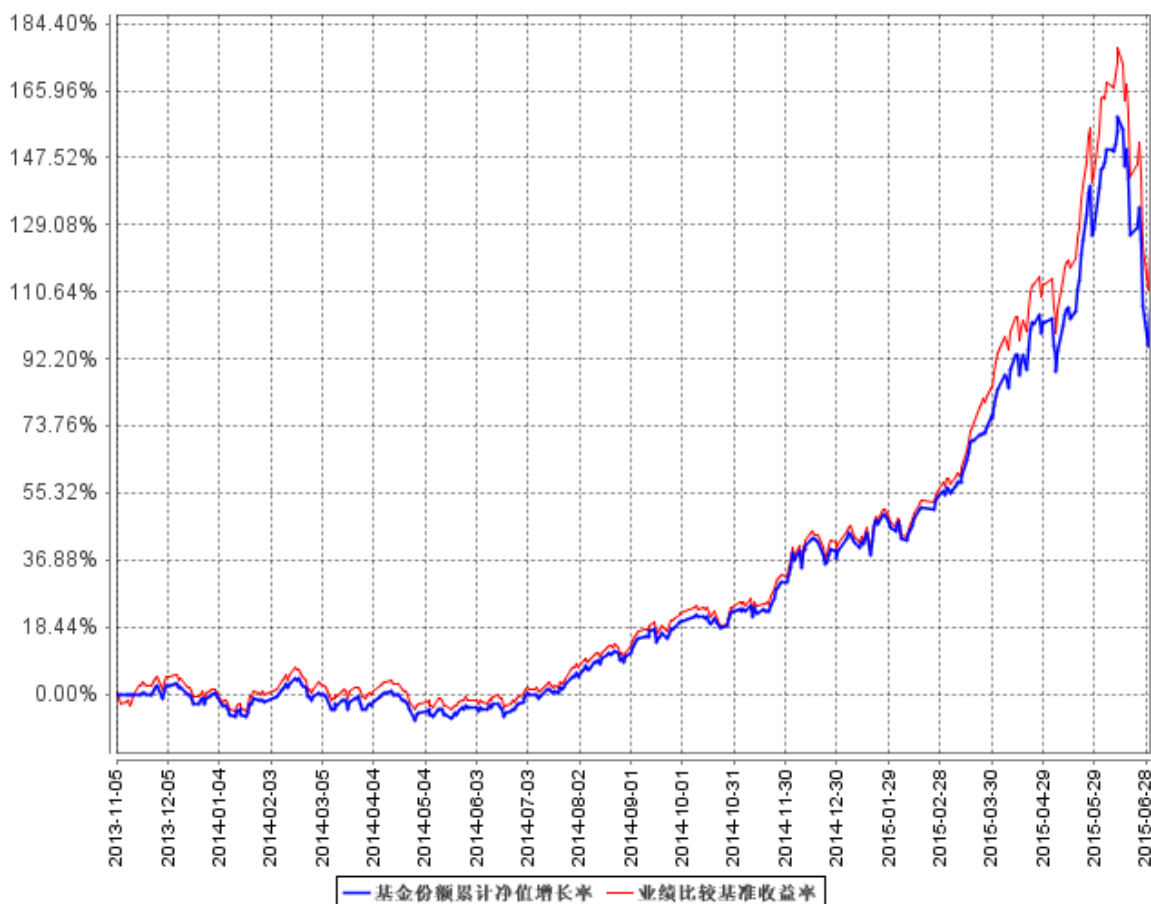
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-9.67%	3.53%	-8.30%	3.56%	-1.37%	-0.03%
过去三个月	17.14%	2.67%	20.62%	2.69%	-3.48%	-0.02%
过去六个月	48.02%	2.10%	57.37%	2.14%	-9.35%	-0.04%
过去一年	109.94%	1.64%	122.24%	1.69%	-12.30%	-0.05%
自基金合同生效起至今	105.93%	1.44%	122.42%	1.50%	-16.49%	-0.06%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起六个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%–95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成分股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

§ 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

银华基金管理有限公司成立于 2001 年 5 月 28 日，是经中国证监会批准(证监基金字[2001]7 号文)设立的全国性资产管理公司。公司注册资本为 2 亿元人民币，公司的股东及其出资比例分别

为：西南证券股份有限公司 49%、第一创业证券股份有限公司 29%、东北证券股份有限公司 21%及山西海鑫实业股份有限公司 1%。公司的主要业务是基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。公司注册地为广东省深圳市。

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金管理人管理着 50 只证券投资基金，具体包括银华优势企业证券投资基金、银华保本增值证券投资基金、银华-道琼斯 88 精选证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、银华核心价值优选股票型证券投资基金、银华优质增长股票型证券投资基金、银华富裕主题股票型证券投资基金、银华领先策略股票型证券投资基金、银华全球核心优选证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)、银华增强收益债券型证券投资基金、银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金、银华沪深 300 指数分级证券投资基金、银华深证 100 指数分级证券投资基金、银华信用债券型证券投资基金 (LOF)、银华成长先锋混合型证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华抗通胀主题证券投资基金 (LOF)、银华中证等权重 90 指数分级证券投资基金、银华永祥保本混合型证券投资基金、银华消费主题分级股票型证券投资基金、银华中证内地资源主题指数分级证券投资基金、银华永泰积极债券型证券投资基金、银华中小盘精选股票型证券投资基金、银华纯债信用主题债券型证券投资基金 (LOF)、上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金、银华上证 50 等权重交易型开放式指数证券投资基金联接基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金 (LOF)、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华交易型货币市场基金、银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金、银华信用四季红债券型证券投资基金、银华中证转债指数增强分级证券投资基金、银华信用季季红债券型证券投资基金、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金、银华永利债券型证券投资基金、银华恒生中国企业指数分级证券投资基金、银华多利宝货币市场基金、银华永益分级债券型证券投资基金和银华活钱宝货币市场基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、银华高端制造业灵活配置混合型证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、银华回报灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、银华泰利灵活配置混合型证券投资基金、银华中国梦 30 股票型证券投资基金、银华恒利灵活配置混合型证券投资基金、银华聚利灵活配置混合型证券投资基金、银华汇利灵活配置混合型证券投资基金、银华稳利灵活配置混合型证券投资基金。同时，本基金管理人管理着多个全国社保基金、企业年金和特定客户资产管理投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

周毅先生	本基金的基金经理、公司副总经理、境外投资部总监、量化投资部总监及量化投资总监	2013年11月5日	-	16年	硕士学位。曾先后担任美国普华永道金融服务部经理、巴克莱银行量化分析部副总裁及巴克莱亚太有限公司副董事等职。2009年9月加盟银华基金管理有限公司，2010年6月21日至2011年12月6日期间兼任银华沪深300指数证券投资基金（LOF）基金经理，2010年8月5日至2012年3月27日期间兼任银华全球核心优选证券投资基金基金经理，2010年12月6日至2012年11月7日期间兼任银华抗通胀主题证券投资基金（LOF）基金经理。自2010年5月7日起兼任银华深证100指数分级证券投资基金基金经理，具有从业资格。国籍：美国。
张凯先生	本基金的基金经理	2013年11月5日	-	5.5年	硕士学位。毕业于清华大学。2009年7月加盟银华基金管理有限公司，曾担任公司量化投资部金融工程助理分析师及基金经理助理职务，自2012年11月14日起兼任银华中证等权重90指数分级证券投资基金基金经理。具有从业资格。国籍：中国。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其各项实施准则、《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定

了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 1 次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在报告期内，我们运用自行开发的投资管理系统，结合量化投资技术和基本面分析对投资组合进行积极的管理和风险控制。本报告期的中前期，本基金小幅度跑赢基准，该结果在模型的收益风险特征预期之内，然而在报告末期市场大幅波动时，大规模的申购赎回导致股票仓位变化剧烈，与基准指数走势发生一定偏差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.859 元，本报告期份额净值增长率为 48.02%，同期业绩比较基准收益率为 57.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015 年上半年是 A 股历史上最不平凡的半年，在经历了五个多月的单边巨幅上涨后，在半个月的时间内又经历了近乎雪崩式的巨幅下跌。以创业板为代表的高成长性板块，大幅度跑赢以沪深 300 为代表的传统蓝筹板块，创业板指数半年内最高涨幅一度高达 170%，部分热门主题个股涨

幅更是惊人；而 6 月的后半个月，以创业板为代表的部分高成长股票开始连续跌停，投资者陷入恐慌，整个权益市场的流动性一度接近枯竭。然而管理层的坚决出手迅速稳定住了局面，并有效地防范了流动性危机转化为金融危机。

我们认为，尽管 A 股经历了一番惊心动魄的恐慌抛售，但驱动长线牛市的基本面、政策面和资金面的因素还在，本轮牛市“改革+创新”的逻辑也还在。一番泥沙俱下的大幅调整，为投资者买到低价优质的资产提供了充分的机会和足够的安全边际。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2014 年 12 月 18 日至 2015 年 2 月 27 日。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（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合规守信、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，对本基金管理人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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。（注：财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。）

§ 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：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,751,681.88	4,053,510.20
结算备付金		346,804.68	329,962.07
存出保证金		24,123.03	60,817.16
交易性金融资产	6.4.7.2	121,062,796.57	40,149,537.94
其中：股票投资		121,062,796.57	40,149,537.94
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,007.38	1,224.08
应收股利		-	-
应收申购款		345,159.95	1,239,294.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		132,533,573.49	45,834,345.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	0.58
应付赎回款		4,176,336.61	1,260,813.71
应付管理人报酬		137,361.00	35,638.12
应付托管费		27,472.20	7,127.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	383,319.82	206,147.62
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	318,870.37	204,733.09
负债合计		5,043,360.00	1,714,460.73
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	61,876,231.72	31,705,146.55
未分配利润	6.4.7.10	65,613,981.77	12,414,738.18
所有者权益合计		127,490,213.49	44,119,884.73
负债和所有者权益总计		132,533,573.49	45,834,345.46

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，800 分级份额净值为人民币 0.859 元，中证 800A 份额净值为人民币 1.006 元，中证 800B 份额净值为人民币 0.712 元；基金份额总额为 148,341,582.72 份，其中 800 分级份额为 67,248,180.72 份，中证 800A 份额为 40,546,701.00 份，中证 800B 份额为 40,546,701.00 份。

6.2 利润表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015 年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年6月30日
一、收入		33,674,720.20	3,101,944.45
1.利息收入		64,075.77	34,964.56
其中：存款利息收入	6.4.7.11	64,075.77	34,964.56
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）		39,719,345.70	-199,102.04
其中：股票投资收益	6.4.7.12	39,252,092.66	-778,861.63
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	467,253.04	579,759.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,613,321.07	3,112,906.51
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	504,619.80	153,175.42
减：二、费用		2,203,798.12	2,607,688.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	486,814.55	502,052.39
2. 托管费	6.4.10.2.2	97,362.89	100,410.48
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,300,013.90	1,691,592.47
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	319,606.78	313,633.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,470,922.08	494,255.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,470,922.08	494,255.46

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	31,705,146.55	12,414,738.18	44,119,884.73

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	31,470,922.08	31,470,922.08
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）	30,171,085.17	21,728,321.51	51,899,406.68
其中：1.基金申购款	244,669,695.09	214,783,860.82	459,453,555.91
2.基金赎回款	-214,498,609.92	-193,055,539.31	-407,554,149.23
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）	61,876,231.72	65,613,981.77	127,490,213.49
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	189,036,621.22	-484,581.79	188,552,039.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	494,255.46	494,255.46
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-117,539,272.86	-1,359,060.13	-118,898,332.99
其中：1.基金申购款	3,779,939.34	-139,306.11	3,640,633.23
2.基金赎回款	-121,319,212.20	-1,219,754.02	-122,538,966.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	71,497,348.36	-1,349,386.46	70,147,961.90

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：

王立新

基金管理人负责人

杨清

主管会计工作负责人

龚飒

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金（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[2013]689 号《关于核准银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金募集的批复》的批准，由银华基金管理有限公司于 2013 年 10 月 9 日至 2013 年 10 月 30 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资出具安永华明（2013）验字第 60468687_A20 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 11 月 5 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 458,146,568.43 元，有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 182,421.19 元，其中人民币 285.70 元系银行应支付本基金的认购款利息与本基金根据基金合同计提的折算基金份额的利息之间的差额，该款项计入基金资产。以上实收基金（本息）合计为人民币 458,328,703.92 元，折合 458,328,703.92 份基金份额。本基金的基金管理人为银华基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之基础份额（即“800 分级份额”）、银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之稳健收益类份额（即“中证 800A 份额”）与银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金之积极收益类份额（即“中证 800B 份额”）。其中，中证 800A 份额、中证 800B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。基金发售结束后，本基金将投资者在场内认购的全部 800 分级份额按照 1:1 的比例自动分离为预期收益与风险不同的两种份额类别，即中证 800A 份额和中证 800B 份额。根据中证 800A 份额和中证 800B 份额的基金份额比例，中证 800A 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，中证 800B 份额在场内基金初始总份额中的份额占比为 50%，且两类基金份额的基金资产合并运作。基金合同生效后，800 分级份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，但不上市交易。中证 800A 份额与中证 800B 份额交易代码不同，只可在深圳证券交易所上市交易，不可单独进行申购或赎回。投资者可在场内申购和赎回 800 分级份额，投资者可选择将其场内申购的 800 分级份额按 1:1 的比例分拆成中证 800A 份额和中证 800B 份额。投资者可按 1:1 的配比将其持有的中证 800A 份额和中证 800B 份额申请合并为 800 分级份额后赎回。投资者可在场外申购和赎回 800 分级份额。场外申购的 800 分级份额不进行分拆，但基金合同另有规定的除外。投资者可将其持有的场外 800 分级份额跨系统转托管至场内并申请将其分拆成中证 800A 份额和中证 800B 份额后上市交易。投资者可按 1:1 的配比将其持有的中证 800A 份额和中证 800B 份额合并为 800 分

级份额后赎回。

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（含首次公开发行和增发）、债券、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—95%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证 800 等权重指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金资产的 80%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证 800 等权重指数收益率} + 5\% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

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（以下统称“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 3 号《半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。

采用若干修订后/新会计准则

2014 年 1 至 3 月，财政部制定了《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》和《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》；修订了《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》和《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》；上述 7 项会计准则均自 2014 年 7 月 1 日起施行。2014 年 6 月，财政部修订了《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，在 2014 年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年度的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

除 6.4.5.2 会计估计变更的说明中所列的会计估计变更事项外，本基金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。

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

本基金本报告期间不涉及会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号《关于发布〈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〉的通知》的规定，自 2015 年 3 月 25 日起，交易所上市交易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)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，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。

7.4.6.2 营业税、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》，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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，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；

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》，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。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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》，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》，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；

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，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	10,751,681.88
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-

合计:	10,751,681.88
-----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	126,382,399.71	121,062,796.57	-5,319,603.14
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	126,382,399.71	121,062,796.57	-5,319,603.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	2,810.92
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	140.81
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	45.84
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	9.81
合计	3,007.38

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	383,319.82
银行间市场应付交易费用	-
合计	383,319.82

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,556.69
标的指数使用基点费	50,000.00
预提费用	253,313.68
合计	318,870.37

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,575,206.26	31,705,146.55
本期申购	16,628,143.31	16,183,131.87
本期赎回(以“-”号填列)	-15,787,462.08	-15,363,668.09
2015 年 3 月 2 日基金拆分/份额 折算前	33,415,887.49	32,524,610.33
基金拆分/份额折算变动份额	54,243,701.73	-
本期申购	402,063,796.05	228,486,563.22
本期赎回(以“-”号填列)	-341,381,802.55	-199,134,941.83
本期末	148,341,582.72	61,876,231.72

注：1、根据《基金合同》规定，投资者可申购、赎回 800 分级份额，中证 800A 份额和中证 800B 份额只可在深圳证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露中证 800A 份额和中证 800B 份额的情况。

2、本基金本报告期进行了两次不定期份额折算，分别于 2015 年 3 月 2 日进行不定期份额折算（上拆），不定期份额折算的基准日为 2015 年 3 月 2 日，本次份额折算变动份额为 17,312,153.09 份。2015 年 5 月 27 日进行第二次不定期份额折算（上拆），不定期份额折算的基准日为 2015 年 5 月 27 日，份额折算变动份额为 36,931,548.64 份。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,558,965.09	-1,144,226.91	12,414,738.18
本期利润	38,084,243.15	-6,613,321.07	31,470,922.08
本期基金份额交易产生的变动数	16,982,942.32	4,745,379.19	21,728,321.51
其中：基金申购款	170,671,218.59	44,112,642.23	214,783,860.82
基金赎回款	-153,688,276.27	-39,367,263.04	-193,055,539.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	68,626,150.56	-3,012,168.79	65,613,981.77

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	58,727.64
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,924.52
其他	423.61
合计	64,075.77

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	410,781,588.52
减：卖出股票成本总额	371,529,495.86
买卖股票差价收入	39,252,092.66

6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	467,253.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	467,253.04

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-6,613,321.07
——股票投资	-6,613,321.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-6,613,321.07

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

基金赎回费收入	504,619.80
合计	504,619.80

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,300,013.90
银行间市场交易费用	-
合计	1,300,013.90

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	148,765.71
标的指数使用基点费	100,000.00
银行汇划费用	7,093.10
账户服务费	9,200.00
上市费	29,752.78
合计	319,606.78

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，本基金并无须作披露的重大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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
银华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
--------------------	--------------

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	486,814.55	502,052.39
其中：支付销售机构的客户维护费	61,003.20	181,757.91

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	97,362.89	100,410.48

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：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行银行间同业市场债券(含回购)

的交易。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金份额。

6.4.10.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

6.4.10.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	10,751,681.88	58,727.64	3,587,722.74	22,875.76

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：根据本基金基金合同的约定，在存续期内，本基金（包括 800 分级份额、中证 800A 份额、中证 800B 份额）不进行收益分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

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
601789	宁波建工	2015年6月15日	重大事项	18.80	2015年8月13日	16.81	24,084	315,514.73	452,779.20	-
000688	建新	2015年	重大	17.07	-	-	26,346	274,890.62	449,726.22	-

	矿业	6月10日	事项							
002194	武汉凡谷	2015年6月18日	重大事项	26.98	2015年7月24日	24.28	13,891	310,643.26	374,779.18	-
600978	宜华木业	2015年6月18日	重大事项	22.44	-	-	14,889	250,641.83	334,109.16	-
000566	海南海药	2015年6月18日	重大事项	49.97	-	-	6,620	277,798.52	330,801.40	-
600641	万业企业	2015年6月12日	重大事项	11.23	-	-	29,359	243,859.83	329,701.57	-
002308	威创股份	2015年6月12日	重大事项	31.00	-	-	10,113	205,110.43	313,503.00	-
002445	中南重工	2015年6月2日	重大事项	57.80	-	-	5,410	226,192.10	312,698.00	-
000066	长城电脑	2015年6月18日	重大事项	21.54	-	-	14,128	273,991.25	304,317.12	-
002018	华信国际	2015年6月15日	重大事项	44.08	-	-	6,863	202,842.04	302,521.04	-
300360	炬华科技	2015年6月15日	重大事项	44.08	-	-	6,800	269,144.00	299,744.00	-
000878	云南铜业	2015年6月8日	重大事项	18.53	-	-	15,692	253,995.42	290,772.76	-
002309	中利科技	2015年6月2日	重大事项	33.39	2015年7月21日	30.05	8,031	211,212.76	268,155.09	-
300144	宋城演艺	2015年6月18日	重大事项	76.47	2015年7月20日	68.82	3,429	246,113.20	262,215.63	-
002191	劲嘉股份	2015年6月18日	重大事项	19.22	-	-	13,511	204,599.44	259,681.42	-
601718	际华集团	2015年6月17日	重大事项	15.12	2015年7月2日	13.61	16,451	163,899.68	248,739.12	-

000650	仁和药业	2015年6月12日	重大事项	17.17	-	-	14,158	178,036.01	243,092.86	-
000850	华茂股份	2015年5月7日	重大事项	10.98	-	-	21,433	232,815.10	235,334.34	-
000778	新兴铸管	2015年6月15日	重大事项	12.96	-	-	18,023	142,289.47	233,578.08	-
002183	怡亚通	2015年6月1日	重大事项	73.15	-	-	3,167	133,438.38	231,666.05	-
300158	振东制药	2015年4月27日	重大事项	18.90	-	-	11,859	192,329.39	224,135.10	-
600110	中科英华	2015年6月26日	重大事项	13.73	-	-	16,194	169,127.94	222,343.62	-
002223	鱼跃医疗	2015年6月25日	重大事项	67.20	2015年7月13日	60.48	3,255	153,576.15	218,736.00	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大事项	34.88	-	-	6,236	203,222.34	217,511.68	-
002226	江南化工	2015年6月8日	重大事项	13.18	-	-	16,212	172,430.82	213,674.16	-
300291	华录百纳	2015年6月30日	重大事项	37.76	2015年7月13日	34.65	5,500	278,731.00	207,680.00	-
000683	远兴能源	2015年6月15日	重大事项	11.52	2015年8月18日	10.37	17,815	126,959.99	205,228.80	-
000539	粤电力A	2015年6月8日	重大事项	11.94	2015年7月21日	10.75	17,011	111,439.56	203,111.34	-
002375	亚厦股份	2015年6月17日	重大事项	29.21	2015年7月20日	26.29	6,684	166,468.21	195,239.64	-
000963	华东医药	2015年6月26日	重大事项	71.48	2015年8月5日	69.20	2,715	185,306.11	194,068.20	-
000709	河北钢铁	2015年6月30日	重大事项	7.00	2015年8月24日	6.30	27,375	141,544.52	191,625.00	-

		日			日						
000732	泰禾集团	2015年6月25日	重大 事项	34.20	2015年7月2日	30.78	5,584	189,340.21	190,972.80	-	
000543	皖能电力	2015年6月15日	重大 事项	21.36	2015年7月14日	19.22	8,678	144,671.92	185,362.08	-	
600335	国机汽车	2015年6月15日	重大 事项	37.93	2015年7月21日	34.14	4,711	144,291.87	178,688.23	-	
601021	春秋航空	2015年6月26日	重大 事项	126.09	2015年7月21日	113.48	1,400	184,474.00	176,526.00	-	
000839	中信国安	2015年6月29日	重大 事项	23.57	-	-	7,429	161,905.80	175,101.53	-	
601111	中国国航	2015年6月30日	重大 事项	15.36	2015年7月29日	13.78	11,149	123,882.57	171,248.64	-	
600153	建发股份	2015年6月29日	重大 事项	17.51	-	-	9,755	150,764.17	170,810.05	-	
600886	国投电力	2015年6月24日	重大 事项	14.87	-	-	11,337	131,459.23	168,581.19	-	
000592	平潭发展	2015年6月30日	重大 事项	29.76	2015年7月14日	30.00	5,600	219,904.00	166,656.00	-	
600175	美都能源	2015年6月29日	重大 事项	10.64	2015年7月20日	9.58	15,455	139,744.60	164,441.20	-	
002242	九阳股份	2015年6月15日	重大 事项	19.45	2015年7月7日	17.51	8,082	133,289.09	157,194.90	-	
600869	智慧能源	2015年5月11日	重大 事项	32.06	2015年7月31日	26.23	4,895	90,714.96	156,933.70	-	
600654	中安消	2015年6月29日	重大 事项	30.91	-	-	4,985	161,567.97	154,086.35	-	
601311	骆驼股份	2015年6月18日	重大 事项	23.31	2015年7月15日	25.38	6,525	159,830.25	152,097.75	-	
600702	沱牌	2015年	重大	26.11	2015年	28.00	5,669	135,906.26	148,017.59	-	

	舍得	6月29日	事项		8月20日						
000519	江南 红箭	2015年 6月15日	重大 事项	26.06	-	-	5,664	118,967.30	147,603.84	-	
601633	长城 汽车	2015年 6月19日	重大 事项	42.76	2015年 7月13日	38.50	3,420	165,943.54	146,239.20	-	
600900	长江 电力	2015年 6月15日	重大 事项	14.35	-	-	10,077	132,034.75	144,604.95	-	
002557	洽洽 食品	2015年 6月29日	重大 事项	16.38	2015年 8月24日	14.74	8,807	171,431.40	144,258.66	-	
601216	内蒙 君正	2015年 6月29日	重大 事项	24.07	2015年 7月2日	24.20	5,889	163,567.68	141,748.23	-	
600520	中发 科技	2015年 5月26日	重大 事项	36.09	2015年 7月24日	32.48	3,891	101,153.03	140,426.19	-	
600643	爱建 股份	2015年 6月30日	重大 事项	16.73	-	-	8,385	157,254.02	140,281.05	-	
002143	印纪 传媒	2015年 6月30日	重大 事项	32.01	2015年 7月1日	33.50	4,347	141,921.14	139,147.47	-	
002238	天威 视讯	2015年 6月29日	重大 事项	23.76	-	-	5,853	139,776.64	139,067.28	-	
000887	中鼎 股份	2015年 6月30日	重大 事项	24.75	-	-	5,600	171,799.95	138,600.00	-	
002276	万马 股份	2015年 6月30日	重大 事项	34.15	2015年 7月20日	30.74	4,030	134,230.11	137,624.50	-	
600312	平高 电气	2015年 6月23日	重大 事项	22.58	-	-	6,026	140,760.03	136,067.08	-	
001696	宗申 动力	2015年 6月30日	重大 事项	17.25	2015年 8月24日	15.53	7,851	179,949.60	135,429.75	-	
601877	正泰 电器	2015年 5月18日	重大 事项	31.38	-	-	4,245	128,314.50	133,208.10	-	

002325	洪涛股份	2015年6月3日	重大事项	31.15	-	-	4,262	96,405.57	132,761.30	-
000672	上峰水泥	2015年6月3日	重大事项	12.05	-	-	10,989	109,074.88	132,417.45	-
600499	科达洁能	2015年6月10日	重大事项	29.64	-	-	4,440	113,346.03	131,601.60	-
002001	新和成	2015年6月30日	重大事项	17.09	2015年7月13日	18.49	7,282	138,169.50	124,449.38	-
002665	首航节能	2015年6月30日	重大事项	27.70	2015年7月1日	30.00	4,344	146,431.56	120,328.80	-
000693	华泽钴镍	2015年6月30日	重大事项	20.57	2015年8月18日	22.63	5,820	165,444.75	119,717.40	-
600395	盘江股份	2015年6月9日	重大事项	15.71	2015年8月19日	14.00	7,308	98,373.69	114,808.68	-
002727	一心堂	2015年4月13日	重大事项	78.24	2015年8月17日	70.42	1,357	76,336.40	106,171.68	-
600482	风帆股份	2015年5月28日	重大事项	42.38	-	-	2,494	55,431.70	105,695.72	-
000786	北新建材	2015年4月10日	重大事项	18.58	-	-	5,684	89,288.42	105,608.72	-
002269	美邦服饰	2015年5月22日	重大事项	11.86	2015年7月2日	10.67	8,672	57,580.45	102,849.92	-
002345	潮宏基	2015年5月22日	重大事项	19.58	-	-	5,050	63,399.61	98,879.00	-
600078	澄星股份	2015年6月9日	重大事项	15.23	2015年7月1日	13.71	6,416	75,375.99	97,715.68	-
600872	中炬高新	2015年5月4日	重大事项	23.17	-	-	4,081	56,561.48	94,556.77	-
000979	中弘股份	2015年5月25日	重大事项	6.04	-	-	15,016	63,673.71	90,696.64	-

		日								
600967	北方创业	2015年4月13日	重大事项	20.86	-	-	4,289	68,261.76	89,468.54	-
600645	中源协和	2015年4月27日	重大事项	81.32	-	-	1,074	63,390.47	87,337.68	-
002574	明牌珠宝	2015年6月4日	重大事项	22.90	-	-	3,708	53,840.05	84,913.20	-
600790	轻纺城	2015年5月25日	重大事项	13.38	2015年8月18日	12.04	6,153	56,334.60	82,327.14	-
002310	东方园林	2015年5月27日	重大事项	38.30	-	-	2,149	49,637.91	82,306.70	-
002292	奥飞动漫	2015年5月18日	重大事项	37.29	-	-	2,204	48,360.90	82,187.16	-
000669	金鸿能源	2015年5月4日	重大事项	41.70	2015年7月23日	33.95	1,963	63,025.18	81,857.10	-
002368	太极股份	2015年5月14日	重大事项	65.52	-	-	1,232	54,746.24	80,720.64	-
600587	新华医疗	2015年5月22日	重大事项	58.63	2015年7月3日	52.77	1,359	58,555.46	79,678.17	-
000959	首钢股份	2015年4月23日	重大事项	6.15	-	-	12,871	63,152.07	79,156.65	-
000024	招商地产	2015年4月3日	重大事项	36.50	-	-	2,149	58,155.15	78,438.50	-
002416	爱施德	2015年5月5日	重大事项	20.67	2015年7月29日	18.60	3,765	67,503.67	77,822.55	-
002414	高德红外	2015年5月13日	重大事项	39.32	-	-	1,915	50,746.77	75,297.80	-
600410	华胜天成	2015年5月28日	重大事项	47.84	2015年7月22日	43.06	1,558	47,863.12	74,534.72	-
000697	炼石	2015年	重大	33.83	-	-	2,150	59,301.64	72,734.50	-

	有色	5月18日	事项								
600366	宁波韵升	2015年5月22日	重大事项	30.71	2015年8月12日	31.58	2,368	54,942.09	72,721.28	-	
000917	电广传媒	2015年5月28日	重大事项	30.81	-	-	2,294	55,749.83	70,678.14	-	
600277	亿利能源	2015年6月1日	重大事项	14.62	-	-	4,722	51,994.83	69,035.64	-	
002091	江苏国泰	2015年6月1日	重大事项	26.22	-	-	2,560	49,316.35	67,123.20	-	
600416	湘电股份	2015年5月22日	重大事项	22.64	2015年7月20日	20.35	2,933	51,448.17	66,403.12	-	
002461	珠江啤酒	2015年6月4日	重大事项	26.40	2015年7月24日	23.76	2,494	40,312.68	65,841.60	-	
600258	首旅酒店	2015年3月17日	重大事项	18.55	-	-	3,482	58,876.48	64,591.10	-	
002662	京威股份	2015年5月15日	重大事项	17.84	2015年8月13日	16.06	3,613	60,616.84	64,455.92	-	
002203	海亮股份	2015年4月27日	重大事项	12.71	-	-	4,876	49,753.35	61,973.96	-	
002106	莱宝高科	2015年4月7日	重大事项	16.42	-	-	3,774	57,748.83	61,969.08	-	
002069	獐子岛	2015年6月1日	重大事项	19.76	-	-	3,105	48,222.61	61,354.80	-	
000793	华闻传媒	2015年5月26日	重大事项	16.89	-	-	3,526	57,185.81	59,554.14	-	
000788	北大医药	2015年5月25日	重大事项	20.72	2015年7月21日	18.65	2,785	50,404.49	57,705.20	-	
600333	长春燃气	2015年5月29日	重大事项	11.97	2015年7月9日	10.77	4,796	45,929.17	57,408.12	-	

600879	航天电子	2015年5月15日	重大事项	23.59	-	-	2,363	45,656.52	55,743.17	-
002353	杰瑞股份	2015年5月27日	重大事项	35.04	-	-	1,256	47,592.11	44,010.24	-
000630	铜陵有色	2015年3月9日	重大事项	10.32	-	-	2,944	22,090.25	30,382.08	-
000761	本钢板材	2015年6月23日	重大事项	7.75	2015年7月21日	6.93	3,559	22,704.63	27,582.25	-
000982	中银绒业	2014年8月25日	重大事项	4.64	-	-	840	3,768.30	3,897.60	-
600575	皖江物流	2014年9月8日	重大事项	4.11	-	-	308	1,173.27	1,265.88	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有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。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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，且通过分散化投资以分散信用风险。

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；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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	10,751,681.88	-	-	-	-	-	10,751,681.88
结算备付金	346,804.68	-	-	-	-	-	346,804.68
存出保证金	24,123.03	-	-	-	-	-	24,123.03
交易性金融资产	-	-	-	-	-	121,062,796.57	121,062,796.57
应收利息	-	-	-	-	-	3,007.38	3,007.38

应收申购款	11,332.01	-	-	-	-	333,827.94	345,159.95
资产总计	11,133,941.60	-	-	-	-	121,399,631.89	132,533,573.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,176,336.61	4,176,336.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	137,361.00	137,361.00
应付托管费	-	-	-	-	-	27,472.20	27,472.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	383,319.82	383,319.82
其他负债	-	-	-	-	-	318,870.37	318,870.37
负债总计	-	-	-	-	-	5,043,360.00	5,043,360.00
利率敏感度缺口	11,133,941.60	-	-	-	-	116,356,271.89	127,490,213.49
上年度末 2014 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	4,053,510.20	-	-	-	-	-	4,053,510.20
结算备付金	329,962.07	-	-	-	-	-	329,962.07
存出保证金	60,817.16	-	-	-	-	-	60,817.16
交易性金融资产	-	-	-	-	-	40,149,537.94	40,149,537.94
应收利息	-	-	-	-	-	1,224.08	1,224.08
应收申购款	-	-	-	-	-	1,239,294.01	1,239,294.01
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,444,289.43	-	-	-	-	41,390,056.03	45,834,345.46
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	0.58	0.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,260,813.71	1,260,813.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	35,638.12	35,638.12
应付托管费	-	-	-	-	-	7,127.61	7,127.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	206,147.62	206,147.62
其他负债	-	-	-	-	-	204,733.09	204,733.09
负债总计	-	-	-	-	-	1,714,460.73	1,714,460.73
利率敏感度缺口	4,444,289.43	-	-	-	-	39,675,595.30	44,119,884.73

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金在 2014 年末及 2015 年 6 月 30 日持有的利率敏感性资产主要为银行存款，除银行存款外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的

金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

在资产类别配置上，本基金股票资产投资比例上限为 95%，且保持不低于基金资产 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。于 2015 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	121,062,796.57	94.96	40,149,537.94	91.00
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	121,062,796.57	94.96	40,149,537.94	91.00

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	+5%	6,095,654.09	2,082,454.58
-5%	-6,095,654.09	-2,082,454.58	

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	121,062,796.57	91.35
	其中：股票	121,062,796.57	91.35
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	11,098,486.56	8.37
7	其他各项资产	372,290.36	0.28
8	合计	132,533,573.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,260,668.25	0.99
B	采矿业	6,668,263.27	5.23
C	制造业	63,489,030.31	49.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,086,610.16	3.99
E	建筑业	3,547,938.73	2.78
F	批发和零售业	6,419,349.52	5.04
G	交通运输、仓储和邮政业	4,474,070.12	3.51
H	住宿和餐饮业	147,808.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,666,663.96	4.44
J	金融业	6,549,948.14	5.14
K	房地产业	6,214,678.17	4.87

L	租赁和商务服务业	2,285,487.96	1.79
M	科学研究和技术服务业	352,357.55	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	901,768.07	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	290,313.36	0.23
R	文化、体育和娱乐业	3,178,634.14	2.49
S	综合	1,033,940.76	0.81
	合计	117,567,530.47	92.22

7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,194,824.00	1.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	452,779.20	0.36
F	批发和零售业	453,370.23	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	329,701.57	0.26
L	租赁和商务服务业	64,591.10	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,495,266.10	2.74

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000688	建新矿业	26,346	449,726.22	0.35
2	002194	武汉凡谷	13,891	374,779.18	0.29
3	600978	宜华木业	14,889	334,109.16	0.26
4	000566	海南海药	6,620	330,801.40	0.26
5	002308	威创股份	10,113	313,503.00	0.25
6	000066	长城电脑	14,128	304,317.12	0.24
7	000001	平安银行	20,922	304,205.88	0.24
8	002018	华信国际	6,863	302,521.04	0.24
9	000878	云南铜业	15,692	290,772.76	0.23
10	600030	中信证券	10,181	273,970.71	0.21
11	600837	海通证券	12,472	271,889.60	0.21
12	002309	中利科技	8,031	268,155.09	0.21
13	600086	东方金钰	4,903	263,634.31	0.21
14	300144	宋城演艺	3,429	262,215.63	0.21
15	002191	劲嘉股份	13,511	259,681.42	0.20
16	601718	际华集团	16,451	248,739.12	0.20
17	000719	大地传媒	11,032	246,234.24	0.19
18	000650	仁和药业	14,158	243,092.86	0.19
19	600797	浙大网新	12,500	236,125.00	0.19
20	600597	光明乳业	10,239	235,497.00	0.18
21	000850	华茂股份	21,433	235,334.34	0.18
22	000778	新兴铸管	18,023	233,578.08	0.18
23	002183	怡亚通	3,167	231,666.05	0.18
24	002249	大洋电机	17,344	222,350.08	0.17
25	600110	中科英华	16,194	222,343.62	0.17
26	600029	南方航空	15,091	219,423.14	0.17
27	600521	华海药业	7,006	218,937.50	0.17
28	002223	鱼跃医疗	3,255	218,736.00	0.17
29	000748	长城信息	6,236	217,511.68	0.17
30	000031	中粮地产	11,355	214,495.95	0.17
31	600428	中远航运	12,949	209,644.31	0.16
32	600703	三安光电	6,672	208,833.60	0.16
33	300291	华录百纳	5,500	207,680.00	0.16

34	000861	海印股份	9,479	203,703.71	0.16
35	000539	粤电力 A	17,011	203,111.34	0.16
36	000426	兴业矿业	12,262	202,445.62	0.16
37	600628	新世界	11,946	200,095.50	0.16
38	600376	首开股份	10,287	198,436.23	0.16
39	600863	内蒙华电	24,258	198,430.44	0.16
40	600115	东方航空	16,050	197,736.00	0.16
41	000538	云南白药	2,280	196,695.60	0.15
42	002375	亚厦股份	6,684	195,239.64	0.15
43	000963	华东医药	2,715	194,068.20	0.15
44	600743	华远地产	24,052	193,137.56	0.15
45	000709	河北钢铁	27,375	191,625.00	0.15
46	000732	泰禾集团	5,584	190,972.80	0.15
47	600826	兰生股份	4,933	190,561.79	0.15
48	600398	海澜之家	10,510	190,546.30	0.15
49	600614	鼎立股份	6,357	189,947.16	0.15
50	600151	航天机电	11,772	188,705.16	0.15
51	601898	中煤能源	16,480	188,201.60	0.15
52	600298	安琪酵母	5,355	186,246.90	0.15
53	002081	金螳螂	6,584	185,602.96	0.15
54	002252	上海莱士	2,833	185,391.52	0.15
55	000543	皖能电力	8,678	185,362.08	0.15
56	600276	恒瑞医药	4,153	184,974.62	0.15
57	000062	深圳华强	3,240	184,906.80	0.15
58	000667	美好集团	27,444	184,423.68	0.14
59	002588	史丹利	6,396	183,885.00	0.14
60	000069	华侨城 A	14,138	183,511.24	0.14
61	002299	圣农发展	9,039	183,491.70	0.14
62	000418	小天鹅 A	7,672	183,360.80	0.14
63	000830	鲁西化工	18,396	183,224.16	0.14
64	600737	中粮屯河	8,767	182,441.27	0.14
65	000858	五粮液	5,735	181,799.50	0.14
66	600325	华发股份	10,010	181,181.00	0.14
67	600017	日照港	22,284	180,723.24	0.14
68	000088	盐田港	12,724	180,171.84	0.14
69	600058	五矿发展	5,510	180,011.70	0.14
70	002475	立讯精密	5,323	179,970.63	0.14
71	600006	东风汽车	14,178	179,777.04	0.14
72	000690	宝新能源	14,204	179,680.60	0.14

73	002479	富春环保	9,752	178,949.20	0.14
74	002244	滨江集团	9,710	178,761.10	0.14
75	600009	上海机场	5,638	178,724.60	0.14
76	600335	国机汽车	4,711	178,688.23	0.14
77	002219	恒康医疗	4,002	177,928.92	0.14
78	600809	山西汾酒	6,296	177,799.04	0.14
79	000951	中国重汽	6,166	177,704.12	0.14
80	000728	国元证券	4,664	177,138.72	0.14
81	600507	方大特钢	19,579	176,994.16	0.14
82	600011	华能国际	12,606	176,862.18	0.14
83	601021	春秋航空	1,400	176,526.00	0.14
84	601888	中国国旅	2,657	176,159.10	0.14
85	300273	和佳股份	5,903	175,850.37	0.14
86	000629	攀钢钒钛	32,802	175,818.72	0.14
87	600765	中航重机	6,393	175,359.99	0.14
88	600340	华夏幸福	5,754	175,209.30	0.14
89	000333	美的集团	4,697	175,104.16	0.14
90	000839	中信国安	7,429	175,101.53	0.14
91	002078	太阳纸业	21,887	175,096.00	0.14
92	600122	宏图高科	10,625	174,462.50	0.14
93	600426	华鲁恒升	9,399	174,445.44	0.14
94	000596	古井贡酒	3,736	174,396.48	0.14
95	600594	益佰制药	3,000	174,390.00	0.14
96	300043	互动娱乐	11,600	174,116.00	0.14
97	000651	格力电器	2,724	174,063.60	0.14
98	000897	津滨发展	18,239	174,000.06	0.14
99	600056	中国医药	7,148	173,982.32	0.14
100	000725	京东方 A	33,492	173,823.48	0.14
101	002393	力生制药	3,801	173,629.68	0.14
102	600664	哈药股份	14,418	173,592.72	0.14
103	000547	闽福发 A	6,500	173,420.00	0.14
104	300017	网宿科技	3,728	173,053.76	0.14
105	002415	海康威视	3,857	172,793.60	0.14
106	600583	海油工程	10,366	172,697.56	0.14
107	600812	华北制药	14,184	172,193.76	0.14
108	600839	四川长虹	17,426	171,471.84	0.13
109	600221	海南航空	26,804	171,277.56	0.13
110	601111	中国国航	11,149	171,248.64	0.13
111	002049	同方国芯	3,565	171,120.00	0.13

112	000568	泸州老窖	5,247	171,104.67	0.13
113	002241	歌尔声学	4,758	170,812.20	0.13
114	600153	建发股份	9,755	170,810.05	0.13
115	002250	联化科技	7,586	169,926.40	0.13
116	600816	安信信托	3,410	169,886.20	0.13
117	600059	古越龙山	11,071	169,607.72	0.13
118	600519	贵州茅台	658	169,533.70	0.13
119	600027	华电国际	15,212	169,157.44	0.13
120	000768	中航飞机	3,875	168,872.50	0.13
121	600535	天士力	3,389	168,636.64	0.13
122	600066	宇通客车	8,205	168,612.75	0.13
123	600886	国投电力	11,337	168,581.19	0.13
124	600690	青岛海尔	5,554	168,452.82	0.13
125	600570	恒生电子	1,496	167,626.80	0.13
126	600741	华域汽车	7,851	167,618.85	0.13
127	600825	新华传媒	10,090	167,393.10	0.13
128	600757	长江传媒	12,037	167,314.30	0.13
129	600252	中恒集团	7,253	166,819.00	0.13
130	000592	平潭发展	5,600	166,656.00	0.13
131	600256	广汇能源	16,004	166,441.60	0.13
132	601006	大秦铁路	11,844	166,289.76	0.13
133	600511	国药股份	3,297	166,135.83	0.13
134	002508	老板电器	4,323	165,830.28	0.13
135	600578	京能电力	18,569	165,821.17	0.13
136	002642	荣之联	2,900	165,735.00	0.13
137	600329	中新药业	6,578	165,699.82	0.13
138	601009	南京银行	7,267	165,687.60	0.13
139	002304	洋河股份	2,378	164,938.08	0.13
140	000423	东阿阿胶	3,026	164,917.00	0.13
141	600787	中储股份	10,243	164,912.30	0.13
142	603288	海天味业	5,155	164,650.70	0.13
143	002701	奥瑞金	6,319	164,483.57	0.13
144	600175	美都能源	15,455	164,441.20	0.13
145	002396	星网锐捷	5,117	164,255.70	0.13
146	600827	百联股份	7,891	164,211.71	0.13
147	601801	皖新传媒	5,621	163,964.57	0.13
148	002503	搜于特	8,674	163,765.12	0.13
149	600887	伊利股份	8,659	163,655.10	0.13
150	600456	宝钛股份	6,277	163,641.39	0.13

151	601939	建设银行	22,936	163,533.68	0.13
152	600795	国电电力	23,460	163,516.20	0.13
153	300027	华谊兄弟	4,283	163,353.62	0.13
154	601908	京运通	7,772	163,056.56	0.13
155	000559	万向钱潮	7,454	162,944.44	0.13
156	002384	东山精密	7,366	162,862.26	0.13
157	000970	中科三环	7,902	162,860.22	0.13
158	601233	桐昆股份	8,144	162,554.24	0.13
159	000552	靖远煤电	11,527	162,530.70	0.13
160	600004	白云机场	9,611	162,425.90	0.13
161	000616	海航投资	15,645	162,395.10	0.13
162	601398	工商银行	30,752	162,370.56	0.13
163	600005	武钢股份	23,050	162,041.50	0.13
164	600651	飞乐音响	7,862	161,721.34	0.13
165	600415	小商品城	10,570	161,509.60	0.13
166	002073	软控股份	6,989	161,445.90	0.13
167	000402	金融街	11,403	161,124.39	0.13
168	300070	碧水源	3,302	161,104.58	0.13
169	600000	浦发银行	9,498	161,086.08	0.13
170	600026	中海发展	12,523	160,795.32	0.13
171	600200	江苏吴中	4,371	160,634.25	0.13
172	601328	交通银行	19,490	160,597.60	0.13
173	000625	长安汽车	7,593	160,591.95	0.13
174	002013	中航机电	5,761	160,443.85	0.13
175	600488	天药股份	16,527	160,146.63	0.13
176	600199	金种子酒	11,426	159,964.00	0.13
177	600859	王府井	5,078	159,957.00	0.13
178	000869	张裕A	3,273	159,689.67	0.13
179	601333	广深铁路	19,402	159,484.44	0.13
180	600403	大有能源	17,835	159,444.90	0.13
181	000550	江铃汽车	4,342	159,351.40	0.12
182	000039	中集集团	4,931	159,271.30	0.12
183	002025	航天电器	6,078	159,243.60	0.12
184	000002	万科A	10,957	159,095.64	0.12
185	000338	潍柴动力	5,024	159,059.84	0.12
186	600566	济川药业	5,390	158,897.20	0.12
187	601998	中信银行	20,606	158,872.26	0.12
188	600422	昆药集团	4,301	158,835.93	0.12
189	300267	尔康制药	4,655	158,688.95	0.12

190	600320	振华重工	15,105	158,602.50	0.12
191	000792	盐湖股份	5,577	158,275.26	0.12
192	000572	海马汽车	18,838	158,050.82	0.12
193	600337	美克家居	10,576	158,005.44	0.12
194	000525	红太阳	7,059	157,909.83	0.12
195	600500	中化国际	9,030	157,844.40	0.12
196	600036	招商银行	8,430	157,809.60	0.12
197	002233	塔牌集团	9,138	157,721.88	0.12
198	000933	神火股份	16,732	157,615.44	0.12
199	002242	九阳股份	8,082	157,194.90	0.12
200	600704	物产中大	6,580	157,130.40	0.12
201	600409	三友化工	13,897	157,036.10	0.12
202	600869	智慧能源	4,895	156,933.70	0.12
203	002146	荣盛发展	12,553	156,912.50	0.12
204	601318	中国平安	1,914	156,833.16	0.12
205	600037	歌华有线	4,978	156,807.00	0.12
206	600736	苏州高新	13,762	156,749.18	0.12
207	300088	长信科技	5,696	156,640.00	0.12
208	000900	现代投资	15,264	156,608.64	0.12
209	000926	福星股份	11,099	156,606.89	0.12
210	603369	今世缘	4,222	156,593.98	0.12
211	002029	七匹狼	7,438	156,198.00	0.12
212	600038	中直股份	2,519	156,052.05	0.12
213	300015	爱尔眼科	4,836	156,009.36	0.12
214	601126	四方股份	5,115	156,007.50	0.12
215	600220	江苏阳光	18,790	155,769.10	0.12
216	601288	农业银行	41,986	155,768.06	0.12
217	601005	重庆钢铁	27,364	155,701.16	0.12
218	000848	承德露露	8,555	155,701.00	0.12
219	600270	外运发展	5,339	155,685.24	0.12
220	000417	合肥百货	12,692	155,477.00	0.12
221	002444	巨星科技	8,411	155,435.28	0.12
222	000780	平庄能源	16,660	155,271.20	0.12
223	600260	凯乐科技	9,422	154,991.90	0.12
224	600880	博瑞传播	9,975	154,911.75	0.12
225	600748	上实发展	9,895	154,856.75	0.12
226	601808	中海油服	5,539	154,759.66	0.12
227	300072	三聚环保	4,591	154,716.70	0.12
228	600675	中华企业	13,674	154,652.94	0.12

229	300146	汤臣倍健	3,937	154,645.36	0.12
230	601928	凤凰传媒	9,039	154,566.90	0.12
231	600125	铁龙物流	10,016	154,546.88	0.12
232	601336	新华保险	2,531	154,542.86	0.12
233	600688	上海石化	14,392	154,426.16	0.12
234	601088	中国神华	7,403	154,352.55	0.12
235	300251	光线传媒	6,197	154,305.30	0.12
236	000860	顺鑫农业	6,733	154,253.03	0.12
237	600674	川投能源	12,330	154,248.30	0.12
238	600284	浦东建设	9,456	154,227.36	0.12
239	300059	东方财富	2,443	154,128.87	0.12
240	601169	北京银行	11,571	154,125.72	0.12
241	600109	国金证券	6,316	154,110.40	0.12
242	000998	隆平高科	5,686	154,090.60	0.12
243	600654	中安消	4,985	154,086.35	0.12
244	600600	青岛啤酒	3,307	154,073.13	0.12
245	600104	上汽集团	6,812	153,951.20	0.12
246	002028	思源电气	8,363	153,879.20	0.12
247	002419	天虹商场	9,047	153,799.00	0.12
248	600983	惠而浦	9,665	153,576.85	0.12
249	600997	开滦股份	17,808	153,504.96	0.12
250	000800	一汽轿车	6,168	153,459.84	0.12
251	600317	营口港	24,355	153,436.50	0.12
252	601098	中南传媒	6,691	153,290.81	0.12
253	000636	风华高科	12,276	153,204.48	0.12
254	000729	燕京啤酒	14,726	153,150.40	0.12
255	600271	航天信息	2,365	153,039.15	0.12
256	000600	建投能源	10,421	152,980.28	0.12
257	600699	均胜电子	3,991	152,895.21	0.12
258	002678	珠江钢琴	7,539	152,890.92	0.12
259	600895	张江高科	5,249	152,798.39	0.12
260	600166	福田汽车	17,284	152,617.72	0.12
261	600435	北方导航	3,363	152,579.31	0.12
262	601258	庞大集团	27,919	152,437.74	0.12
263	601231	环旭电子	8,956	152,341.56	0.12
264	002251	步步高	6,243	152,329.20	0.12
265	600640	号百控股	5,273	152,284.24	0.12
266	600016	民生银行	15,312	152,201.28	0.12
267	603366	日出东方	10,352	152,174.40	0.12

268	601311	骆驼股份	6,525	152,097.75	0.12
269	600673	东阳光科	15,374	152,048.86	0.12
270	000921	海信科龙	12,459	151,999.80	0.12
271	603001	奥康国际	4,868	151,978.96	0.12
272	000937	冀中能源	18,949	151,970.98	0.12
273	300199	翰宇药业	4,700	151,951.00	0.12
274	600118	中国卫星	2,665	151,798.40	0.12
275	002236	大华股份	4,751	151,651.92	0.12
276	002155	辰州矿业	12,196	151,596.28	0.12
277	601601	中国太保	5,023	151,594.14	0.12
278	002340	格林美	9,962	151,522.02	0.12
279	600085	同仁堂	4,216	151,396.56	0.12
280	600383	金地集团	11,968	151,395.20	0.12
281	600885	宏发股份	4,830	151,372.20	0.12
282	600636	三爱富	7,457	151,227.96	0.12
283	600259	广晟有色	2,578	151,225.48	0.12
284	002430	杭氧股份	11,438	151,210.36	0.12
285	002646	青青稞酒	5,181	151,181.58	0.12
286	000825	太钢不锈	21,255	151,123.05	0.12
287	000983	西山煤电	15,940	151,111.20	0.12
288	600873	梅花生物	14,467	151,035.48	0.12
289	000898	鞍钢股份	20,685	151,000.50	0.12
290	600019	宝钢股份	17,275	150,983.50	0.12
291	600485	信威集团	3,439	150,937.71	0.12
292	600729	重庆百货	4,689	150,892.02	0.12
293	600776	东方通信	9,137	150,669.13	0.12
294	600141	兴发集团	8,736	150,521.28	0.12
295	000100	TCL 集团	26,637	150,499.05	0.12
296	300033	同花顺	1,750	150,482.50	0.12
297	000021	深科技	9,865	150,441.25	0.12
298	002128	露天煤业	9,126	150,396.48	0.12
299	300124	汇川技术	3,129	150,192.00	0.12
300	600171	上海贝岭	6,139	150,098.55	0.12
301	600547	山东黄金	6,074	150,027.80	0.12
302	002225	濮耐股份	15,852	149,959.92	0.12
303	601989	中国重工	10,131	149,938.80	0.12
304	000049	德赛电池	3,141	149,825.70	0.12
305	002168	深圳惠程	9,647	149,721.44	0.12
306	601857	中国石油	13,212	149,691.96	0.12

307	600309	万华化学	6,190	149,674.20	0.12
308	002317	众生药业	5,306	149,576.14	0.12
309	300039	上海凯宝	9,619	149,575.45	0.12
310	600039	四川路桥	22,902	149,550.06	0.12
311	601666	平煤股份	19,752	149,522.64	0.12
312	603328	依顿电子	4,875	149,467.50	0.12
313	603899	晨光文具	3,731	149,463.86	0.12
314	000488	晨鸣纸业	16,649	149,341.53	0.12
315	601999	出版传媒	10,497	149,267.34	0.12
316	002051	中工国际	5,012	149,257.36	0.12
317	000028	国药一致	2,002	149,169.02	0.12
318	600015	华夏银行	9,793	148,951.53	0.12
319	600351	亚宝药业	10,995	148,872.30	0.12
320	002022	科华生物	3,482	148,542.12	0.12
321	002551	尚荣医疗	3,423	148,523.97	0.12
322	000012	南玻A	11,128	148,447.52	0.12
323	000895	双汇发展	6,956	148,371.48	0.12
324	600429	三元股份	13,139	148,339.31	0.12
325	002635	安洁科技	6,091	148,315.85	0.12
326	002705	新宝股份	7,889	148,313.20	0.12
327	600048	保利地产	12,985	148,288.70	0.12
328	600867	通化东宝	6,760	148,246.80	0.12
329	601628	中国人寿	4,733	148,237.56	0.12
330	000027	深圳能源	12,002	148,224.70	0.12
331	600509	天富能源	10,532	148,185.24	0.12
332	000166	申万宏源	9,115	148,118.75	0.12
333	000961	中南建设	7,417	148,117.49	0.12
334	600588	用友网络	3,228	148,100.64	0.12
335	600073	上海梅林	11,443	148,072.42	0.12
336	000511	烯碳新材	12,085	148,041.25	0.12
337	600803	新奥股份	8,652	148,035.72	0.12
338	600702	沱牌舍得	5,669	148,017.59	0.12
339	601866	中海集运	15,574	147,953.00	0.12
340	600160	巨化股份	13,421	147,899.42	0.12
341	600585	海螺水泥	6,893	147,854.85	0.12
342	601991	大唐发电	18,528	147,853.44	0.12
343	600348	阳泉煤业	14,423	147,835.75	0.12
344	600754	锦江股份	4,960	147,808.00	0.12
345	601101	昊华能源	12,959	147,732.60	0.12

346	600481	双良节能	6,166	147,675.70	0.12
347	000540	中天城投	11,715	147,609.00	0.12
348	000519	江南红箭	5,664	147,603.84	0.12
349	600028	中国石化	20,904	147,582.24	0.12
350	002470	金正大	6,797	147,562.87	0.12
351	601929	吉视传媒	9,759	147,556.08	0.12
352	600851	海欣股份	11,634	147,286.44	0.12
353	000883	湖北能源	16,890	147,280.80	0.12
354	002277	友阿股份	8,582	147,267.12	0.12
355	002373	千方科技	3,400	147,186.00	0.12
356	002294	信立泰	5,146	147,175.60	0.12
357	600316	洪都航空	4,254	147,103.32	0.12
358	600208	新湖中宝	19,052	147,081.44	0.12
359	600720	祁连山	13,888	147,073.92	0.12
360	600489	中金黄金	11,427	147,065.49	0.12
361	600660	福耀玻璃	10,295	147,012.60	0.12
362	000581	威孚高科	4,743	146,985.57	0.12
363	002142	宁波银行	6,949	146,971.35	0.12
364	600657	信达地产	17,831	146,927.44	0.12
365	000999	华润三九	4,834	146,905.26	0.12
366	601992	金隅股份	12,284	146,793.80	0.12
367	601166	兴业银行	8,509	146,780.25	0.12
368	002038	双鹭药业	2,590	146,723.50	0.12
369	002399	海普瑞	4,315	146,666.85	0.12
370	600648	外高桥	4,179	146,599.32	0.11
371	002153	石基信息	1,127	146,498.73	0.11
372	600694	大商股份	2,650	146,492.00	0.11
373	002024	苏宁云商	9,573	146,466.90	0.11
374	601818	光大银行	27,311	146,386.96	0.11
375	600551	时代出版	6,742	146,368.82	0.11
376	000009	中国宝安	8,974	146,365.94	0.11
377	002179	中航光电	4,434	146,322.00	0.11
378	002008	大族激光	5,094	146,299.68	0.11
379	603699	纽威股份	5,853	146,266.47	0.11
380	601633	长城汽车	3,420	146,239.20	0.11
381	000685	中山公用	4,968	146,208.24	0.11
382	002190	成飞集成	2,867	146,188.33	0.11
383	600088	中视传媒	4,530	146,183.10	0.11
384	002311	海大集团	10,598	146,146.42	0.11

385	600572	康恩贝	6,435	146,074.50	0.11
386	600516	方大炭素	12,263	146,052.33	0.11
387	600332	白云山	4,236	145,972.56	0.11
388	600618	氯碱化工	10,749	145,971.42	0.11
389	600780	通宝能源	15,024	145,883.04	0.11
390	600196	复星医药	5,039	145,828.66	0.11
391	002174	游族网络	1,572	145,818.72	0.11
392	600546	山煤国际	17,126	145,742.26	0.11
393	002400	省广股份	5,768	145,699.68	0.11
394	600150	中国船舶	2,828	145,642.00	0.11
395	600389	江山股份	4,662	145,640.88	0.11
396	000930	中粮生化	7,720	145,522.00	0.11
397	000826	桑德环境	3,740	145,448.60	0.11
398	600201	金宇集团	2,045	145,440.40	0.11
399	002477	雏鹰农牧	7,574	145,420.80	0.11
400	600783	鲁信创投	3,879	145,384.92	0.11
401	000598	兴蓉投资	15,170	145,176.90	0.11
402	000030	富奥股份	12,545	145,145.65	0.11
403	600138	中青旅	6,872	145,136.64	0.11
404	600062	华润双鹤	5,573	145,120.92	0.11
405	600893	中航动力	2,730	145,099.50	0.11
406	000931	中关村	10,320	145,099.20	0.11
407	603766	隆鑫通用	5,779	145,052.90	0.11
408	002202	金风科技	7,445	144,954.15	0.11
409	000422	湖北宜化	15,698	144,892.54	0.11
410	600759	洲际油气	9,482	144,884.96	0.11
411	002428	云南锗业	6,157	144,751.07	0.11
412	601933	永辉超市	12,485	144,701.15	0.11
413	600900	长江电力	10,077	144,604.95	0.11
414	002648	卫星石化	9,549	144,571.86	0.11
415	600487	亨通光电	3,928	144,550.40	0.11
416	002431	棕榈园林	4,974	144,345.48	0.11
417	002663	普邦园林	14,876	144,297.20	0.11
418	000877	天山股份	12,312	144,296.64	0.11
419	000962	东方钨业	9,749	144,285.20	0.11
420	002557	洽洽食品	8,807	144,258.66	0.11
421	000090	天健集团	5,946	144,190.50	0.11
422	002570	贝因美	7,427	144,158.07	0.11
423	600884	杉杉股份	5,037	144,058.20	0.11

424	002161	远望谷	6,617	143,985.92	0.11
425	000726	鲁泰A	10,358	143,976.20	0.11
426	601225	陕西煤业	17,589	143,878.02	0.11
427	300202	聚龙股份	3,560	143,824.00	0.11
428	600617	国新能源	7,861	143,620.47	0.11
429	000652	泰达股份	14,098	143,517.64	0.11
430	600300	维维股份	14,130	143,419.50	0.11
431	600881	亚泰集团	11,271	143,254.41	0.11
432	002281	光迅科技	2,978	143,182.24	0.11
433	601678	滨化股份	15,961	143,170.17	0.11
434	000823	超声电子	10,634	143,133.64	0.11
435	600557	康缘药业	5,143	143,129.69	0.11
436	002466	天齐锂业	2,316	143,128.80	0.11
437	000735	罗牛山	15,230	143,009.70	0.11
438	600637	百视通	3,398	142,987.84	0.11
439	002181	粤传媒	9,727	142,986.90	0.11
440	002129	中环股份	7,224	142,962.96	0.11
441	601965	中国汽研	10,986	142,927.86	0.11
442	600418	江淮汽车	10,148	142,883.84	0.11
443	002056	横店东磁	4,566	142,824.48	0.11
444	000939	凯迪电力	9,747	142,793.55	0.11
445	600188	兖州煤业	10,377	142,683.75	0.11
446	002030	达安基因	3,218	142,557.40	0.11
447	601800	中国交建	8,107	142,358.92	0.11
448	000661	长春高新	1,095	142,350.00	0.11
449	600468	百利电气	6,105	142,307.55	0.11
450	000681	视觉中国	3,465	142,272.90	0.11
451	000671	阳光城	6,845	142,239.10	0.11
452	601168	西部矿业	13,023	142,211.16	0.11
453	601369	陕鼓动力	12,139	142,147.69	0.11
454	002489	浙江永强	3,766	141,978.20	0.11
455	601699	潞安环能	14,681	141,965.27	0.11
456	600176	中国巨石	5,243	141,875.58	0.11
457	601216	内蒙君正	5,889	141,748.23	0.11
458	600183	生益科技	13,906	141,702.14	0.11
459	002004	华邦颖泰	10,916	141,689.68	0.11
460	002410	广联达	6,055	141,687.00	0.11
461	000513	丽珠集团	2,088	141,629.04	0.11
462	002007	华兰生物	3,195	141,506.55	0.11

463	600216	浙江医药	10,654	141,485.12	0.11
464	600261	阳光照明	17,400	141,462.00	0.11
465	600811	东方集团	11,469	141,412.77	0.11
466	600596	新安股份	10,141	141,365.54	0.11
467	002437	誉衡药业	4,866	141,357.30	0.11
468	600108	亚盛集团	13,644	141,351.84	0.11
469	600079	人福医药	3,815	141,345.75	0.11
470	000718	苏宁环球	9,785	141,197.55	0.11
471	601919	中国远洋	11,308	141,123.84	0.11
472	600663	陆家嘴	2,836	141,062.64	0.11
473	600655	豫园商城	8,787	141,031.35	0.11
474	600372	中航电子	4,037	141,012.41	0.11
475	601208	东材科技	12,341	140,934.22	0.11
476	600971	恒源煤电	15,395	140,864.25	0.11
477	002271	东方雨虹	5,479	140,810.30	0.11
478	002267	陕天然气	9,087	140,757.63	0.11
479	002456	欧菲光	4,167	140,594.58	0.11
480	000973	佛塑科技	11,713	140,556.00	0.11
481	601158	重庆水务	13,087	140,554.38	0.11
482	600018	上港集团	17,769	140,552.79	0.11
483	300104	乐视网	2,713	140,424.88	0.11
484	600373	中文传媒	5,856	140,309.76	0.11
485	000703	恒逸石化	10,995	140,296.20	0.11
486	600643	爱建股份	8,385	140,281.05	0.11
487	000620	新华联	10,298	140,258.76	0.11
488	002465	海格通信	4,354	140,155.26	0.11
489	000876	新希望	7,217	140,081.97	0.11
490	002681	奋达科技	5,100	140,046.00	0.11
491	002344	海宁皮城	7,120	139,765.60	0.11
492	600498	烽火通信	5,280	139,708.80	0.11
493	000063	中兴通讯	5,858	139,478.98	0.11
494	600436	片仔癀	2,092	139,473.64	0.11
495	601607	上海医药	6,261	139,432.47	0.11
496	600157	永泰能源	20,262	139,402.56	0.11
497	603555	贵人鸟	3,335	139,336.30	0.11
498	600497	驰宏锌锗	9,547	139,290.73	0.11
499	600773	西藏城投	7,909	139,277.49	0.11
500	601000	唐山港	10,173	139,268.37	0.11
501	000919	金陵药业	7,148	139,243.04	0.11

502	000413	东旭光电	14,231	139,179.18	0.11
503	000006	深振业 A	10,255	139,160.35	0.11
504	600289	亿阳信通	6,982	139,151.26	0.11
505	002275	桂林三金	5,444	139,148.64	0.11
506	002143	印纪传媒	4,347	139,147.47	0.11
507	600008	首创股份	9,696	139,137.60	0.11
508	600120	浙江东方	4,104	139,084.56	0.11
509	002238	天威视讯	5,853	139,067.28	0.11
510	600801	华新水泥	13,154	139,037.78	0.11
511	002392	北京利尔	16,091	139,026.24	0.11
512	002490	山东墨龙	11,574	139,003.74	0.11
513	000631	顺发恒业	17,177	138,961.93	0.11
514	600874	创业环保	10,898	138,949.50	0.11
515	601001	大同煤业	15,033	138,904.92	0.11
516	601899	紫金矿业	27,127	138,890.24	0.11
517	600184	光电股份	4,932	138,885.12	0.11
518	600639	浦东金桥	5,713	138,768.77	0.11
519	002064	华峰氨纶	15,292	138,698.44	0.11
520	603005	晶方科技	2,835	138,659.85	0.11
521	300024	机器人	1,794	138,604.44	0.11
522	000887	中鼎股份	5,600	138,600.00	0.11
523	600998	九州通	6,193	138,475.48	0.11
524	600580	卧龙电气	7,761	138,378.63	0.11
525	002440	闰土股份	5,772	138,354.84	0.11
526	600705	中航资本	5,975	138,321.25	0.11
527	600089	特变电工	9,337	138,280.97	0.11
528	600586	金晶科技	20,098	138,274.24	0.11
529	600177	雅戈尔	7,571	138,246.46	0.11
530	002573	国电清新	6,688	138,240.96	0.11
531	000582	北部湾港	6,497	138,191.19	0.11
532	600060	海信电器	5,608	137,900.72	0.11
533	600831	广电网络	8,123	137,847.31	0.11
534	300133	华策影视	5,105	137,835.00	0.11
535	002672	东江环保	6,517	137,834.55	0.11
536	600993	马应龙	4,294	137,794.46	0.11
537	002450	康得新	4,503	137,791.80	0.11
538	002405	四维图新	3,145	137,751.00	0.11
539	600510	黑牡丹	8,870	137,662.40	0.11
540	002276	万马股份	4,030	137,624.50	0.11

541	000157	中联重科	16,962	137,561.82	0.11
542	600362	江西铜业	6,393	137,513.43	0.11
543	600755	厦门国贸	12,232	137,487.68	0.11
544	600999	招商证券	5,196	137,486.16	0.11
545	600563	法拉电子	4,442	137,479.90	0.11
546	002595	豪迈科技	6,368	137,421.44	0.11
547	601377	兴业证券	10,033	137,351.77	0.11
548	000852	江钻股份	4,055	137,261.75	0.11
549	600685	广船国际	2,552	137,144.48	0.11
550	600517	置信电气	8,759	137,078.35	0.11
551	002092	中泰化学	13,452	137,075.88	0.11
552	000501	鄂武商 A	6,685	137,042.50	0.11
553	601886	江河创建	9,209	137,029.92	0.11
554	603698	航天工程	3,476	137,023.92	0.11
555	000541	佛山照明	11,939	136,940.33	0.11
556	600835	上海机电	4,156	136,898.64	0.11
557	600496	精工钢构	18,724	136,872.44	0.11
558	000969	安泰科技	9,518	136,868.84	0.11
559	000099	中信海直	7,691	136,745.98	0.11
560	300147	香雪制药	4,438	136,690.40	0.11
561	002230	科大讯飞	3,912	136,685.28	0.11
562	002594	比亚迪	2,474	136,639.02	0.11
563	002482	广田股份	5,004	136,609.20	0.11
564	000425	徐工机械	10,291	136,561.57	0.11
565	600132	重庆啤酒	6,063	136,538.76	0.11
566	600850	华东电脑	2,464	136,480.96	0.11
567	601179	中国西电	13,314	136,468.50	0.11
568	000078	海王生物	6,202	136,444.00	0.11
569	600219	南山铝业	13,508	136,295.72	0.11
570	600010	包钢股份	26,260	136,289.40	0.11
571	002653	海思科	5,046	136,242.00	0.11
572	603077	和邦股份	6,550	136,240.00	0.11
573	600031	三一重工	14,049	136,134.81	0.11
574	000680	山推股份	15,346	136,119.02	0.11
575	600808	马钢股份	25,586	136,117.52	0.11
576	600312	平高电气	6,026	136,067.08	0.11
577	600823	世茂股份	10,437	135,994.11	0.11
578	601668	中国建筑	16,365	135,993.15	0.11
579	002065	东华软件	4,730	135,987.50	0.11

580	300115	长盈精密	4,081	135,938.11	0.11
581	000960	锡业股份	6,746	135,931.90	0.11
582	601688	华泰证券	5,875	135,888.75	0.11
583	600292	中电远达	4,441	135,628.14	0.11
584	603000	人民网	2,601	135,590.13	0.11
585	000046	泛海控股	9,253	135,556.45	0.11
586	002480	新筑股份	8,336	135,543.36	0.11
587	600068	葛洲坝	11,589	135,475.41	0.11
588	001696	宗申动力	7,851	135,429.75	0.11
589	000623	吉林敖东	4,029	135,374.40	0.11
590	000776	广发证券	5,972	135,265.80	0.11
591	600425	青松建化	13,772	135,241.04	0.11
592	002463	沪电股份	16,195	135,228.25	0.11
593	601901	方正证券	11,364	135,117.96	0.11
594	600518	康美药业	7,618	135,067.14	0.11
595	600894	广日股份	6,763	134,989.48	0.11
596	300058	蓝色光标	8,515	134,622.15	0.11
597	601880	大连港	18,691	134,575.20	0.11
598	600064	南京高科	6,901	134,569.50	0.11
599	600761	安徽合力	8,037	134,459.01	0.11
600	600770	综艺股份	6,880	134,435.20	0.11
601	002315	焦点科技	1,400	134,400.00	0.11
602	000762	西藏矿业	7,073	134,387.00	0.11
603	600549	厦门钨业	5,319	134,357.94	0.11
604	300244	迪安诊断	1,600	134,304.00	0.11
605	300253	卫宁软件	2,581	134,212.00	0.11
606	601777	力帆股份	8,496	134,151.84	0.11
607	300002	神州泰岳	8,800	134,112.00	0.11
608	600917	重庆燃气	10,606	134,059.84	0.11
609	600633	浙报传媒	6,836	133,985.60	0.11
610	600352	浙江龙盛	9,447	133,863.99	0.10
611	601099	太平洋	10,357	133,812.44	0.10
612	600023	浙能电力	13,487	133,791.04	0.10
613	600642	申能股份	13,365	133,783.65	0.10
614	600717	天津港	8,923	133,755.77	0.10
615	600522	中天科技	5,883	133,720.59	0.10
616	002237	恒邦股份	11,164	133,633.08	0.10
617	600864	哈投股份	8,248	133,617.60	0.10
618	002204	大连重工	10,001	133,613.36	0.10

619	600111	北方稀土	7,364	133,582.96	0.10
620	600240	华业地产	8,750	133,525.00	0.10
621	002216	三全食品	9,081	133,490.70	0.10
622	600718	东软集团	6,140	133,422.20	0.10
623	002240	威华股份	9,837	133,389.72	0.10
624	002736	国信证券	5,314	133,328.26	0.10
625	002011	盾安环境	9,199	133,293.51	0.10
626	600750	江中药业	4,135	133,105.65	0.10
627	002371	七星电子	3,502	133,076.00	0.10
628	600601	方正科技	14,623	133,069.30	0.10
629	002140	东华科技	5,951	133,064.36	0.10
630	600067	冠城大通	13,413	133,056.96	0.10
631	002385	大北农	9,838	133,009.76	0.10
632	600267	海正药业	7,073	132,901.67	0.10
633	601600	中国铝业	14,239	132,849.87	0.10
634	600970	中材国际	9,085	132,822.70	0.10
635	601118	海南橡胶	13,580	132,812.40	0.10
636	603188	亚邦股份	4,634	132,810.44	0.10
637	002325	洪涛股份	4,262	132,761.30	0.10
638	600170	上海建工	14,147	132,698.86	0.10
639	000060	中金岭南	7,130	132,546.70	0.10
640	002041	登海种业	7,489	132,480.41	0.10
641	600406	国电南瑞	6,398	132,374.62	0.10
642	600804	鹏博士	4,430	132,279.80	0.10
643	002254	泰和新材	8,214	132,245.40	0.10
644	601117	中国化学	13,522	132,245.16	0.10
645	002285	世联行	6,166	132,199.04	0.10
646	000400	许继电气	5,251	132,115.16	0.10
647	002358	森源电气	6,150	132,102.00	0.10
648	000997	新大陆	4,966	132,095.60	0.10
649	000401	冀东水泥	10,027	131,855.05	0.10
650	002118	紫鑫药业	7,620	131,826.00	0.10
651	000563	陕国投 A	9,358	131,667.06	0.10
652	000783	长江证券	9,435	131,618.25	0.10
653	002327	富安娜	10,665	131,606.10	0.10
654	600499	科达洁能	4,440	131,601.60	0.10
655	600143	金发科技	11,029	131,465.68	0.10
656	300274	阳光电源	4,300	131,451.00	0.10
657	600460	士兰微	14,234	131,379.82	0.10

658	002122	天马股份	12,334	131,357.10	0.10
659	002673	西部证券	4,625	131,211.25	0.10
660	600537	亿晶光电	7,330	131,207.00	0.10
661	601958	金铂股份	11,135	131,170.30	0.10
662	600198	大唐电信	3,701	131,163.44	0.10
663	000988	华工科技	7,346	130,832.26	0.10
664	002005	德豪润达	11,396	130,826.08	0.10
665	002050	三花股份	11,382	130,779.18	0.10
666	002332	仙琚制药	7,535	130,506.20	0.10
667	002342	巨力索具	13,781	130,506.07	0.10
668	601608	中信重工	8,000	130,400.00	0.10
669	600161	天坛生物	3,461	130,341.26	0.10
670	600180	瑞茂通	4,539	130,087.74	0.10
671	603993	洛阳钼业	10,512	129,928.32	0.10
672	002273	水晶光电	4,155	129,843.75	0.10
673	601717	郑煤机	11,901	129,839.91	0.10
674	601139	深圳燃气	12,362	129,801.00	0.10
675	000528	柳工	10,974	129,712.68	0.10
676	603019	中科曙光	1,498	129,711.82	0.10
677	601012	隆基股份	8,212	129,256.88	0.10
678	600584	长电科技	6,763	129,240.93	0.10
679	000758	中色股份	6,582	129,204.66	0.10
680	000503	海虹控股	2,636	129,164.00	0.10
681	002408	齐翔腾达	7,532	129,098.48	0.10
682	600050	中国联通	17,588	128,920.04	0.10
683	000750	国海证券	7,670	128,856.00	0.10
684	600536	中国软件	3,631	128,827.88	0.10
685	600397	安源煤业	13,308	128,688.36	0.10
686	600805	悦达投资	8,232	128,666.16	0.10
687	600958	东方证券	4,493	128,589.66	0.10
688	600525	长园集团	6,247	128,500.79	0.10
689	601555	东吴证券	6,276	128,469.72	0.10
690	002424	贵州百灵	2,049	128,185.44	0.10
691	002195	二三四五	3,080	128,004.80	0.10
692	601226	华电重工	8,045	127,995.95	0.10
693	002500	山西证券	7,075	127,986.75	0.10
694	600158	中体产业	4,457	127,693.05	0.10
695	000156	华数传媒	3,567	127,627.26	0.10
696	600251	冠农股份	9,190	127,097.70	0.10

697	600280	中央商场	9,114	126,411.18	0.10
698	600875	东方电气	6,173	126,361.31	0.10
699	600187	国中水务	16,176	126,172.80	0.10
700	000777	中核科技	3,840	126,144.00	0.10
701	600100	同方股份	5,998	125,898.02	0.10
702	600478	科力远	7,394	125,845.88	0.10
703	002063	远光软件	4,011	125,423.97	0.10
704	002221	东华能源	4,193	125,077.19	0.10
705	000415	渤海租赁	13,208	124,947.68	0.10
706	002698	博实股份	2,362	124,713.60	0.10
707	300134	大富科技	4,457	124,573.15	0.10
708	002001	新和成	7,282	124,449.38	0.10
709	000829	天音控股	8,371	124,309.35	0.10
710	000975	银泰资源	7,204	124,124.92	0.10
711	601727	上海电气	8,299	123,904.07	0.10
712	000656	金科股份	17,923	123,847.93	0.10
713	600169	太原重工	13,911	123,807.90	0.10
714	002293	罗莱家纺	6,826	123,482.34	0.10
715	600446	金证股份	1,000	123,460.00	0.10
716	600392	盛和资源	4,836	123,366.36	0.10
717	000816	江淮动力	11,922	123,273.48	0.10
718	601618	中国中冶	17,018	123,040.14	0.10
719	000712	锦龙股份	3,505	123,025.50	0.10
720	000831	五矿稀土	4,806	122,937.48	0.10
721	601106	中国一重	10,144	122,843.84	0.10
722	603169	兰石重装	6,640	122,773.60	0.10
723	600112	天成控股	6,444	122,436.00	0.10
724	600195	中牧股份	4,333	121,757.30	0.10
725	600635	大众公用	12,444	121,702.32	0.10
726	601018	宁波港	13,761	121,647.24	0.10
727	000061	农产品	5,913	120,625.20	0.09
728	002266	浙富控股	8,813	120,561.84	0.09
729	002665	首航节能	4,344	120,328.80	0.09
730	002390	信邦制药	6,725	120,243.00	0.09
731	601669	中国电建	10,564	119,795.76	0.09
732	000693	华泽钴镍	5,820	119,717.40	0.09
733	600611	大众交通	7,167	119,330.55	0.09
734	601969	海南矿业	6,537	119,169.51	0.09
735	600021	上海电力	5,625	118,687.50	0.09

736	601002	晋亿实业	7,496	118,586.72	0.09
737	600739	辽宁成大	4,833	118,166.85	0.09
738	002093	国脉科技	7,346	117,536.00	0.09
739	000587	金叶珠宝	5,078	117,454.14	0.09
740	600545	新疆城建	7,801	117,093.01	0.09
741	002048	宁波华翔	5,618	116,798.22	0.09
742	000603	盛达矿业	4,651	115,995.94	0.09
743	601515	东风股份	5,741	115,968.20	0.09
744	600395	盘江股份	7,308	114,808.68	0.09
745	601186	中国铁建	7,298	114,067.74	0.09
746	600528	中铁二局	6,797	113,985.69	0.09
747	600458	时代新材	4,541	113,979.10	0.09
748	600380	健康元	7,480	113,396.80	0.09
749	601010	文峰股份	11,546	112,804.42	0.09
750	600433	冠豪高新	7,231	111,285.09	0.09
751	601390	中国中铁	7,868	107,712.92	0.08
752	002727	一心堂	1,357	106,171.68	0.08
753	600482	风帆股份	2,494	105,695.72	0.08
754	000786	北新建材	5,684	105,608.72	0.08
755	002269	美邦服饰	8,672	102,849.92	0.08
756	601766	中国南车	5,590	102,632.40	0.08
757	002345	潮宏基	5,050	98,879.00	0.08
758	600872	中炬高新	4,081	94,556.77	0.07
759	000979	中弘股份	15,016	90,696.64	0.07
760	600967	北方创业	4,289	89,468.54	0.07
761	600645	中源协和	1,074	87,337.68	0.07
762	002574	明牌珠宝	3,708	84,913.20	0.07
763	600790	轻纺城	6,153	82,327.14	0.06
764	002310	东方园林	2,149	82,306.70	0.06
765	002292	奥飞动漫	2,204	82,187.16	0.06
766	000669	金鸿能源	1,963	81,857.10	0.06
767	002368	太极股份	1,232	80,720.64	0.06
768	600387	海越股份	3,160	80,643.20	0.06
769	600587	新华医疗	1,359	79,678.17	0.06
770	000024	招商地产	2,149	78,438.50	0.06
771	002414	高德红外	1,915	75,297.80	0.06
772	600410	华胜天成	1,558	74,534.72	0.06
773	000697	炼石有色	2,150	72,734.50	0.06
774	600366	宁波韵升	2,368	72,721.28	0.06

775	000917	电广传媒	2,294	70,678.14	0.06
776	600277	亿利能源	4,722	69,035.64	0.05
777	002091	江苏国泰	2,560	67,123.20	0.05
778	600416	湘电股份	2,933	66,403.12	0.05
779	002461	珠江啤酒	2,494	65,841.60	0.05
780	002662	京威股份	3,613	64,455.92	0.05
781	002203	海亮股份	4,876	61,973.96	0.05
782	002106	莱宝高科	3,774	61,969.08	0.05
783	002069	獐子岛	3,105	61,354.80	0.05
784	000793	华闻传媒	3,526	59,554.14	0.05
785	000788	北大医药	2,785	57,705.20	0.05
786	600879	航天电子	2,363	55,743.17	0.04
787	002353	杰瑞股份	1,256	44,010.24	0.03
788	000630	铜陵有色	2,944	30,382.08	0.02
789	600747	大连控股	3,607	28,603.51	0.02
790	600649	城投控股	541	7,595.64	0.01
791	600575	皖江物流	308	1,265.88	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601789	宁波建工	24,084	452,779.20	0.36
2	600828	成商集团	35,972	375,547.68	0.29
3	600641	万业企业	29,359	329,701.57	0.26
4	002445	中南重工	5,410	312,698.00	0.25
5	300360	炬华科技	6,800	299,744.00	0.24
6	002123	荣信股份	10,414	231,711.50	0.18
7	300158	振东制药	11,859	224,135.10	0.18
8	002226	江南化工	16,212	213,674.16	0.17
9	000683	远兴能源	17,815	205,228.80	0.16
10	600520	中发科技	3,891	140,426.19	0.11
11	601877	正泰电器	4,245	133,208.10	0.10
12	000672	上峰水泥	10,989	132,417.45	0.10
13	600078	澄星股份	6,416	97,715.68	0.08
14	000959	首钢股份	12,871	79,156.65	0.06
15	002416	爱施德	3,765	77,822.55	0.06
16	600258	首旅酒店	3,482	64,591.10	0.05

17	600333	长春燃气	4,796	57,408.12	0.05
18	300147	香雪制药	1,163	35,820.40	0.03
19	000761	本钢板材	3,559	27,582.25	0.02
20	000982	中银绒业	840	3,897.60	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	000001	平安银行	2,863,748.88	6.49
2	000776	广发证券	2,455,661.83	5.57
3	601166	兴业银行	2,445,861.00	5.54
4	601328	交通银行	2,286,802.00	5.18
5	601318	中国平安	2,110,262.00	4.78
6	600551	时代出版	2,031,511.94	4.60
7	601939	建设银行	1,856,983.00	4.21
8	601998	中信银行	1,705,105.00	3.86
9	601098	中南传媒	1,572,952.86	3.57
10	601186	中国铁建	1,517,828.00	3.44
11	002142	宁波银行	1,462,302.00	3.31
12	601088	中国神华	1,462,299.00	3.31
13	601168	西部矿业	1,448,911.79	3.28
14	601009	南京银行	1,444,294.66	3.27
15	601886	江河创建	1,425,164.00	3.23
16	600362	江西铜业	1,420,455.33	3.22
17	600000	浦发银行	1,405,014.00	3.18
18	600546	山煤国际	1,393,941.00	3.16
19	002445	中南重工	1,389,672.76	3.15
20	601169	北京银行	1,389,431.00	3.15
21	601398	工商银行	1,388,118.00	3.15
22	600036	招商银行	1,374,083.00	3.11
23	000623	吉林敖东	1,358,514.00	3.08
24	000688	建新矿业	1,349,624.19	3.06

25	600757	长江传媒	1,346,991.16	3.05
26	600016	民生银行	1,327,611.00	3.01
27	601288	农业银行	1,320,788.00	2.99
28	000869	张裕A	1,319,080.00	2.99
29	600015	华夏银行	1,310,555.00	2.97
30	000858	五粮液	1,310,511.00	2.97
31	601929	吉视传媒	1,275,883.00	2.89
32	000751	锌业股份	1,273,901.00	2.89
33	600199	金种子酒	1,272,804.92	2.88
34	600216	浙江医药	1,271,503.00	2.88
35	000848	承德露露	1,269,832.00	2.88
36	601818	光大银行	1,262,113.00	2.86
37	601607	上海医药	1,261,494.14	2.86
38	600252	中恒集团	1,248,133.50	2.83
39	600812	华北制药	1,242,828.00	2.82
40	600488	天药股份	1,234,669.00	2.80
41	600997	开滦股份	1,209,594.00	2.74
42	600037	歌华有线	1,193,651.00	2.71
43	600067	冠城大通	1,192,491.00	2.70
44	000963	华东医药	1,185,158.00	2.69
45	601668	中国建筑	1,178,801.00	2.67
46	000402	金融街	1,178,048.00	2.67
47	600859	王府井	1,173,302.12	2.66
48	600386	北巴传媒	1,166,913.88	2.64
49	600251	冠农股份	1,155,364.00	2.62
50	601117	中国化学	1,148,140.00	2.60
51	002393	力生制药	1,147,448.88	2.60
52	601801	皖新传媒	1,141,259.00	2.59
53	600064	南京高科	1,136,983.00	2.58
54	600056	中国医药	1,134,074.00	2.57
55	600831	广电网络	1,133,035.18	2.57
56	600809	山西汾酒	1,123,671.02	2.55
57	000156	华数传媒	1,117,007.00	2.53
58	601601	中国太保	1,106,809.10	2.51
59	300251	光线传媒	1,103,062.00	2.50
60	000878	云南铜业	1,102,001.33	2.50

61	600780	通宝能源	1,077,907.00	2.44
62	601857	中国石油	1,074,256.00	2.43
63	600694	大商股份	1,056,499.00	2.39
64	601789	宁波建工	1,053,289.00	2.39
65	002275	桂林三金	1,049,658.20	2.38
66	600153	建发股份	1,038,719.70	2.35
67	601808	中海油服	1,035,063.00	2.35
68	000600	建投能源	1,031,849.00	2.34
69	600322	天房发展	1,031,244.76	2.34
70	000423	东阿阿胶	1,030,656.00	2.34
71	601989	中国重工	1,028,011.00	2.33
72	600298	安琪酵母	1,027,925.00	2.33
73	002238	天威视讯	1,023,747.95	2.32
74	601137	博威合金	1,023,344.34	2.32
75	002001	新 和 成	1,016,808.50	2.30
76	600048	保利地产	1,016,603.00	2.30
77	000651	格力电器	1,006,058.12	2.28
78	600467	好当家	999,483.00	2.27
79	600578	京能电力	993,693.00	2.25
80	000002	万 科 A	991,713.00	2.25
81	600166	福田汽车	990,516.00	2.25
82	002400	省广股份	987,461.00	2.24
83	600811	东方集团	980,873.00	2.22
84	600028	中国石化	979,394.00	2.22
85	002309	中利科技	971,011.23	2.20
86	000543	皖能电力	961,762.00	2.18
87	600383	金地集团	960,609.00	2.18
88	601126	四方股份	958,428.00	2.17
89	600373	中文传媒	938,527.57	2.13
90	000951	中国重汽	937,764.43	2.13
91	000063	中兴通讯	935,760.00	2.12
92	601006	大秦铁路	934,679.00	2.12
93	000850	华茂股份	932,670.00	2.11
94	000338	潍柴动力	930,351.00	2.11
95	600104	上汽集团	925,630.00	2.10
96	300133	华策影视	921,587.44	2.09

97	000926	福星股份	920,594.00	2.09
98	000823	超声电子	918,830.00	2.08
99	601766	中国中车	914,614.72	2.07
100	600128	弘业股份	914,215.00	2.07
101	601928	凤凰传媒	906,557.00	2.05
102	000725	京东方 A	905,359.00	2.05
103	600089	特变电工	901,669.00	2.04
104	600027	华电国际	892,000.00	2.02
105	600875	东方电气	888,464.00	2.01
106	600031	三一重工	888,128.62	2.01
107	600880	博瑞传播	886,451.00	2.01
108	000726	鲁泰 A	885,547.00	2.01
109	600761	安徽合力	885,525.00	2.01

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	000001	平安银行	2,896,133.97	6.56
2	601166	兴业银行	2,652,439.91	6.01
3	000776	广发证券	2,467,327.68	5.59
4	601328	交通银行	2,304,470.55	5.22
5	600551	时代出版	2,275,989.86	5.16
6	601318	中国平安	2,271,750.94	5.15
7	601939	建设银行	1,800,628.51	4.08
8	600546	山煤国际	1,626,981.88	3.69
9	600362	江西铜业	1,609,561.07	3.65
10	601998	中信银行	1,578,934.62	3.58
11	601088	中国神华	1,565,706.98	3.55
12	601098	中南传媒	1,564,698.79	3.55
13	000751	锌业股份	1,562,394.61	3.54
14	601886	江河创建	1,524,195.34	3.45
15	600000	浦发银行	1,495,905.22	3.39
16	601186	中国铁建	1,487,372.90	3.37
17	601168	西部矿业	1,441,508.16	3.27
18	002445	中南重工	1,412,504.80	3.20

19	000858	五 粮 液	1,408,147.56	3.19
20	601009	南京银行	1,406,434.07	3.19
21	601668	中国建筑	1,403,191.91	3.18
22	600216	浙江医药	1,397,691.25	3.17
23	601607	上海医药	1,397,244.45	3.17
24	002142	宁波银行	1,390,974.32	3.15
25	600386	北巴传媒	1,381,216.64	3.13
26	000869	张 裕 A	1,351,973.19	3.06
27	601169	北京银行	1,337,328.94	3.03
28	601398	工商银行	1,328,035.93	3.01
29	600812	华北制药	1,326,616.50	3.01
30	600015	华夏银行	1,325,736.13	3.00
31	600036	招商银行	1,322,839.03	3.00
32	600757	长江传媒	1,317,316.72	2.99
33	600859	王府井	1,297,062.08	2.94
34	600488	天药股份	1,292,240.52	2.93
35	000623	吉林敖东	1,286,571.51	2.92
36	601288	农业银行	1,260,646.80	2.86
37	000848	承德露露	1,252,538.52	2.84
38	600252	中恒集团	1,250,683.61	2.83
39	600016	民生银行	1,250,118.56	2.83
40	601808	中海油服	1,241,629.75	2.81
41	600199	金种子酒	1,227,287.08	2.78
42	000688	建新矿业	1,221,282.31	2.77
43	601818	光大银行	1,217,007.78	2.76
44	600067	冠城大通	1,202,713.49	2.73
45	002238	天威视讯	1,199,763.16	2.72
46	600251	冠农股份	1,199,749.24	2.72
47	600997	开滦股份	1,194,405.99	2.71
48	601117	中国化学	1,189,918.83	2.70
49	600322	天房发展	1,187,779.89	2.69
50	600467	好当家	1,178,160.91	2.67
51	600064	南京高科	1,168,829.67	2.65
52	601137	博威合金	1,160,294.79	2.63
53	600037	歌华有线	1,153,876.92	2.62
54	601601	中国太保	1,140,875.55	2.59
55	600048	保利地产	1,135,864.01	2.57
56	601929	吉视传媒	1,130,081.78	2.56

57	000963	华东医药	1,120,516.32	2.54
58	002393	力生制药	1,120,203.43	2.54
59	000402	金融街	1,117,165.59	2.53
60	600056	中国医药	1,112,901.29	2.52
61	002090	金智科技	1,098,977.89	2.49
62	600694	大商股份	1,094,467.22	2.48
63	600831	广电网络	1,094,376.71	2.48
64	600153	建发股份	1,093,672.12	2.48
65	002292	奥飞动漫	1,088,768.41	2.47
66	002275	桂林三金	1,081,310.87	2.45
67	600809	山西汾酒	1,079,620.23	2.45
68	600028	中国石化	1,075,497.60	2.44
69	600383	金地集团	1,073,204.60	2.43
70	600811	东方集团	1,070,919.77	2.43
71	601801	皖新传媒	1,070,599.67	2.43
72	600128	弘业股份	1,066,483.42	2.42
73	600780	通宝能源	1,066,171.87	2.42
74	002300	太阳电缆	1,062,249.71	2.41
75	600523	贵航股份	1,047,275.93	2.37
76	000423	东阿阿胶	1,046,707.66	2.37
77	600166	福田汽车	1,046,232.34	2.37
78	000002	万科A	1,045,290.34	2.37
79	600373	中文传媒	1,043,765.75	2.37
80	600377	宁沪高速	1,042,869.23	2.36
81	000063	中兴通讯	1,042,734.96	2.36
82	601766	中国中车	1,041,111.17	2.36
83	600350	山东高速	1,039,819.38	2.36
84	000651	格力电器	1,034,980.33	2.35
85	600280	中央商场	1,024,185.28	2.32
86	601989	中国重工	1,021,348.34	2.31
87	002001	新和成	1,011,233.15	2.29
88	600298	安琪酵母	1,010,747.80	2.29
89	600050	中国联通	1,009,967.64	2.29
90	600578	京能电力	1,008,292.40	2.29
91	000600	建投能源	1,004,169.42	2.28
92	002400	省广股份	1,003,142.51	2.27
93	600105	永鼎股份	998,270.55	2.26
94	002042	华孚色纺	996,963.25	2.26

95	000338	潍柴动力	996,394.49	2.26
96	601006	大秦铁路	994,978.80	2.26
97	601857	中国石油	990,020.68	2.24
98	000759	中百集团	988,707.92	2.24
99	000823	超声电子	987,508.08	2.24
100	000156	华数传媒	980,695.32	2.22
101	600345	长江通信	980,188.17	2.22
102	600724	宁波富达	977,965.96	2.22
103	601126	四方股份	977,261.99	2.22
104	600020	中原高速	976,910.76	2.21
105	000798	中水渔业	976,613.21	2.21
106	600089	特变电工	970,472.41	2.20
107	002567	唐人神	970,269.84	2.20
108	000533	万家乐	955,775.69	2.17
109	600548	深高速	936,822.83	2.12
110	000878	云南铜业	932,253.77	2.11
111	300251	光线传媒	931,615.34	2.11
112	300102	乾照光电	928,841.37	2.11
113	000951	中国重汽	926,844.64	2.10
114	600637	东方明珠	925,901.53	2.10
115	000543	皖能电力	923,611.61	2.09
116	002309	中利科技	922,901.03	2.09
117	600353	旭光股份	922,103.14	2.09
118	000966	长源电力	919,145.77	2.08
119	600011	华能国际	918,083.78	2.08
120	002668	奥马电器	916,987.21	2.08
121	002062	宏润建设	909,541.98	2.06
122	600823	世茂股份	904,098.75	2.05
123	600785	新华百货	900,890.59	2.04
124	002338	奥普光电	900,781.69	2.04
125	300252	金信诺	899,587.15	2.04
126	600027	华电国际	898,445.69	2.04
127	600104	上汽集团	895,073.44	2.03
128	000157	中联重科	894,660.21	2.03
129	000926	福星股份	893,795.63	2.03
130	600197	伊力特	892,211.15	2.02

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

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	459,056,075.56
卖出股票收入（成交）总额	410,781,588.52

注：“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

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	24,123.03

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,007.38
5	应收申购款	345,159.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	372,290.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000688	建新矿业	449,726.22	0.35	重大事项
2	002194	武汉凡谷	374,779.18	0.29	重大事项
3	600978	宜华木业	334,109.16	0.26	重大事项
4	000566	海南海药	330,801.40	0.26	重大事项
5	002308	威创股份	313,503.00	0.25	重大事项
6	000066	长城电脑	304,317.12	0.24	重大事项
7	002018	华信国际	302,521.04	0.24	重大事项

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601789	宁波建工	452,779.20	0.36	重大事项
2	600641	万业企业	329,701.57	0.26	重大事项
3	002445	中南重工	312,698.00	0.25	重大事项
4	300360	炬华科技	299,744.00	0.24	重大事项

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
中证 800A	324	125,144.14	31,993,794.00	78.91%	8,552,907.00	21.09%
中证 800B	2,047	19,807.87	30,090.00	0.07%	40,516,611.00	99.93%
800 分级	2,611	25,755.72	8,137,746.66	12.10%	59,110,434.06	87.90%
合计	4,982	29,775.51	40,161,630.66	27.07%	108,179,952.06	72.93%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

中证 800A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中华联合财产保险股份有限公司—传统保险产品	21,269,977.00	52.46%
2	太平资产—工商银行—太平之星 20 号投资产品	7,767,338.00	19.16%
3	宁波鼎锋海川投资管理中心（有限合伙）—鼎锋另类策略 2 期证券投资基金	1,000,000.00	2.47%
4	黄国柱	969,670.00	2.39%
5	姜凤伶	707,492.00	1.74%
6	富安达基金—光大银行—富安达—利可 1 号资产管理计划	641,051.00	1.58%
7	西南证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	580,000.00	1.43%
8	陈均连	529,408.00	1.31%
9	泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L—CT001 深	488,700.00	1.21%

10	吴汉彬	477,300.00	1.18%
----	-----	------------	-------

中证 800B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄志强	1,372,900.00	3.39%
2	中国银河证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	943,401.00	2.33%
3	阮文君	920,000.00	2.27%
4	周东彪	690,000.00	1.70%
5	张宏玉	450,700.00	1.11%
6	李超英	440,000.00	1.09%
7	游俊杰	400,000.00	0.99%
8	赵仲杰	394,400.00	0.97%
9	李志江	370,000.00	0.91%
10	胡艳云	329,800.00	0.81%

注：以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中证 800A	-	-
	中证 800B	-	-
	800 分级	272,590.30	0.41%
	合计	272,590.30	0.18%

注：对于分级基金，下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额，合计数比例的分母采用期末基金份额总额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中证 800A	中证 800B	800 分级
基金合同生效日（2013 年 11 月 5 日）	-	-	458,328,703.92
基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	2,152,169.00	2,152,169.00	28,270,868.26
本报告期基金总申购份额	-	-	418,691,939.36
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	357,169,264.63
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	38,394,532.00	38,394,532.00	-22,545,362.27
本报告期末基金份额总额	40,546,701.00	40,546,701.00	67,248,180.72

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额和不定期折算份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2015 年 6 月 10 日发布公告，凌宇翔先生自 2015 年 6 月 8 日起担任本基金管理人副总经理，代为履行督察长职务。

本基金管理人于 2015 年 7 月 25 日发布公告，自 2015 年 7 月 24 日起聘任杨文辉先生担任本基金管理人督察长，凌宇翔先生自该日起不再代任督察长职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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、基金财产以及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，基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未变更为其审计的会计师事务所。

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、托管人的托管业务部门及其相关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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券股份有限公司	4	868,895,807.32	100.00%	791,043.57	100.00%	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
上海华信证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
航空证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
首创证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华鑫证券有限	1	-	-	-	-	-

责任公司						
联讯证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	-
山西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	新增 2 个交 易单元
华西证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增 1 个交 易单元

注：1、基金专用交易单元的选择标准为该证券经营机构具有较强的研究服务能力，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告、市场服务报告以及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序为根据标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。经公司批准后与被选择的证券经营机构签订协议。

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
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

第一创业证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
上海华信证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
航空证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

首创证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末通过交易单元进行债券交易、债券回购交易及权证交易。

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	《银华基金管理有限公司 2014 年 12 月 31 日基金净值公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 1 月 5 日
2	《银华中证 800 等权重指数增强分 级证券投资基金 2014 年第 4 季度 报告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 1 月 20 日
3	《银华中证 800 等权重指数增强分 级证券投资基金可能发生不定期 份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 1 月 27 日
4	《银华基金管理有限公司关于增 加深圳众禄基金销售有限公司为 旗下部分基金代销机构并参加其 费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 1 月 29 日
5	《银华中证 800 等权重指数增强分 级证券投资基金可能发生不定期 份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 2 月 3 日
6	《银华基金管理有限公司关于旗 下部分基金持有的新华保险估值 方法调整的公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 2 月 3 日
7	《银华中证 800 等权重指数增强分 级证券投资基金可能发生不定期 份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基 金管理人网站	2015 年 2 月 5 日

8	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华侨城 A 估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 9 日
9	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的新开普估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 13 日
10	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东方财富估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 13 日
11	《银华基金管理有限公司关于开通通联支付业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 14 日
12	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 25 日
13	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 2 月 27 日
14	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 2 日
15	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 2 日
16	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间银华 800A 份额、银华 800B 份额停复牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 3 日
17	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的歌华有线估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 3 日
18	《关于银华 800A、银华 800B 份额不定期份额折算后前收盘价调整的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 4 日
19	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 4 日
20	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的大北农估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 5 日
21	《银华基金管理有限公司关于暂停网上交易业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 6 日
22	《关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 10 日

	并参加其费率优惠活动的公告》		
23	《银华基金管理有限公司关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金变更子份额场内简称的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 12 日
24	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金托管协议（2015 年 3 月修订）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 12 日
25	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同（2015 年 3 月修订）》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 12 日
26	《关于增加杭州数米基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 13 日
27	《关于旗下部分基金持有的长安汽车、高新兴、中天科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 17 日
28	《关于旗下部分基金持有的探路者、海航投资、吉林森工估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 19 日
29	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的涪陵榨菜、中国国旅、众业达估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 23 日
30	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的光明乳业、盛运股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 24 日
31	《银华基金管理有限公司关于增加太平洋证券为旗下部分基金代销机构的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 25 日
32	《银华基金管理有限公司关于增加中金公司为旗下部分基金代销及转换业务办理机构并参加其费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 26 日
33	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2014 年年度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 28 日
34	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2014 年年度报告摘要》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 3 月 28 日
35	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的阳光电源、美克家居、铜陵有色、安泰科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 3 日
36	《银华基金管理有限公司关于旗	三大证券报及本基	2015 年 4 月 8 日

	下部分基金持有的复星医药估值方法调整的公告》	金管理人网站	
37	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的招商银行、银座股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 13 日
38	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的北方创业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 16 日
39	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中环股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 18 日
40	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金 2015 年第 1 季度报告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 22 日
41	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东方航空、久联发展、模塑科技、博晖创新估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 24 日
42	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长电科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 25 日
43	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的东华软件估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 25 日
44	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的紫金矿业估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
45	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳众禄基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 29 日
46	《银华基金管理有限公司关于旗下部分指数型证券投资基金变更场内简称的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 4 月 30 日
47	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金鸿能源估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 6 日
48	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的雷曼光电、银河电子、芭田股份、航天机电估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 13 日
49	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的招商地产估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 15 日

50	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的中国北车、中国南车、方大炭素、华润万东估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 21 日
51	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
52	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的广陆数测、智慧能源估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 22 日
53	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金螳螂、正泰电器、亿帆鑫富、国睿科技、多氟多、深科技、高德红外、长信科技估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 23 日
54	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 26 日
55	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 27 日
56	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理不定期份额折算业务的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 27 日
57	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的金浦钛业、奥飞动漫、中炬高新、航天电子、中源协和、奥瑞金估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 27 日
58	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间中证 800A 份额、中证 800B 份额停复牌的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 28 日
59	《关于银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
60	《关于中证 800A、中证 800B 份额不定期份额折算后前收盘价调整的风险提示公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 29 日
61	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的三安光电、腾邦国际估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金管理人网站	2015 年 5 月 30 日
62	《银华基金管理有限公司关于旗	三大证券报及本基	2015 年 6 月 4 日

	下部分基金持有的宁波韵升、银星能源、探路者、天壕节能、四维图新估值方法调整的公告》	金管理人网站	
63	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的广汇能源估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 10 日
64	《银华基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 10 日
65	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的华闻传媒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 12 日
66	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 19 日
67	《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金更新招募说明书摘要（2015 年第 1 号）》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 19 日
68	《关于旗下部分基金持有的常山药业、国金证券、金亚科技、云南铜业、大立科技、信质电机估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 20 日
69	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金参加杭州数米基金销售有限公司网上费率优惠活动的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 26 日
70	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的茂业物流、电广传媒估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 27 日
71	《银华基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的新界泵业、哈空调、通源石油、兴源环境、骆驼股份估值方法调整的公告》	三大证券报及本基金经理人网站	2015 年 6 月 27 日

§ 11 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

- 12.1.1 中国证监会核准银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金设立的文件
- 12.1.2 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金招募说明书》
- 12.1.3 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金基金合同》
- 12.1.4 《银华中证 800 等权重指数增强分级证券投资基金托管协议》
- 12.1.5 《银华基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 12.1.6 银华基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- 12.1.7 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 12.1.8 报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理有限公司
2015 年 8 月 26 日