（上接B510版）

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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率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；处置时其公允价值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也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和基金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也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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10次，每次收益分配比例不得低于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。

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；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准。

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。

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票，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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 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。

(4) 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

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

6.4.6.1

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买债券的差价收入不予征收营业税。

6.4.6.2

对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.3

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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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未发生变化。

6.4.7.2 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
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
工商银行	基金托管人、代销机构
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构

6.4.8 本报告期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月9日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国联证券	12,842,226.90	15.06%

债券交易注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

债券回购交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月9日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国联证券	11,691.64	15.88%	11,691.64	11.27%

注1：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

注2：该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月9日至2015年6月30日
当期应支付的管理费	37,907.91
其中：支付销售机构的客户维护费	12,706.88

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提，计算方法如下：

H=E×1.5%/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，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年6月9日至2015年6月30日
当期应支付的托管费	6,346.24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/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，逐日累计至每月月底，按月支付。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月9日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	13,694,415.28	10,133.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并按银行间同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未通过关联方购买其承销的证券。

6.4.9 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金在本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	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
600763	冠豪奔腾	2015年6月26日	临时停牌	26.11	-	-	46,900	1,420,726.60	3000301,224,559.00
300030	阳普医疗	2015年6月24日	临时停牌	27.34	2015年7月13日	17.78	18,100	531,235.00	494,854.00
600416	湘电股份	2015年7月2日	临时停牌	47.84	2015年7月23日	43.06	5,191	150,326.72	248,337.44
600822	中物高新	2015年6月24日	临时停牌	21.62	-	-	11,013	132,719.21	238,101.06
600687	新华医疗	2015年6月11日	临时停牌	58.63	2015年7月3日	52.77	2,326	87,588.26	136,373.38
600482	风帆股份	2015年6月17日	临时停牌	42.38	-	-	2,517	46,123.96	106,670.46
600272	亿利能源	2015年6月29日	临时停牌	14.62	-	-	6,163	64,355.39	90,103.06
600386	鹿王股份	2015年6月8日	临时停牌	15.71	-	-	5,215	64,363.62	81,927.65
600796	钱江生化	2015年6月22日	临时停牌	13.38	-	-	5,796	43,477.00	77,516.28
601877	正泰电器	2015年6月23日	临时停牌	30.62	-	-	2,317	59,028.25	70,946.54
600416	湘电股份	2015年6月23日	临时停牌	22.64	2015年7月30日	20.35	3,059	47,691.76	69,255.76
600869	智慧能源	2015年6月8日	临时停牌	29.14	2015年7月31日	26.23	1,854	24,642.45	54,316.95
600578	凯迪股份	2015年6月10日	临时停牌	15.23	2015年7月1日	13.71	3,180	28,166.30	48,431.40
600575	皖江物流	2014年9月8日	临时停牌	4.11	-	-	9,765	35,857.40	40,134.15
600568	中珠控股	2015年6月11日	临时停牌	24.10	-	-	1,318	20,616.85	31,763.00
600832	东方明珠	2015年6月16日	临时停牌	13.42	-	-	2,226	21,667.04	29,872.92
600333	长春燃气	2015年6月26日	临时停牌	11.97	2015年7月9日	10.77	2,464	22,185.04	29,494.08
600561	江西长运	2015年5月30日	临时停牌	19.48	-	-	1,421	21,379.82	27,681.06
600778	友好集团	2015年6月1日	临时停牌	16.10	-	-	1,583	16,946.80	25,486.30
600167	联美控股	2015年6月26日	临时停牌	25.76	-	-	978	15,753.96	25,193.28
600284	浦东建设	2015年6月26日	临时停牌	18.55	-	-	656	9,446.97	12,168.80
601311	骆驼股份	2015年6月10日	临时停牌	28.20	2015年7月10日	25.88	36	598.17	1,015.20
600366	宁波韵升	2015年6月22日	临时停牌	30.71	2015年7月12日	31.58	3,194	61,965.64	98,087.74
600676	交运股份	2015年6月22日	临时停牌	19.14	2015年7月7日	17.78	3,549	34,825.73	67,927.86
600967	北方创业	2015年5月13日	临时停牌	20.85	-	-	9,410	146,348.73	196,198.50

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

§7 投资组合报告(转型前)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	36,109,954.78	86.53
	其中：股票	36,109,954.78	86.53
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	4,202,073.63	10.07
7	其他资产	1,419,218.30	3.40
8	合计	41,731,246.71	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	117,049.64	0.28
B	采矿业	1,330,204.09	3.26
C	制造业	19,245,063.52	46.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,362,585.97	5.73
F	建筑业	3,799,393.33	9.23
G	批发和零售业	3,797,519.65	9.13
H	交通运输、仓储和邮政业	2,909,289.49	7.13
I	住宿和餐饮业	393,939.02	0.95
J	信息传输、软件和信息技术服务业	1,362,397.93	3.28
K	金融业	0.00	0.00
L	房地产业	3,107,696.72	7.60
M	租赁和商务服务业	639,266.01	1.46
N	科学研究和技术服务业	27,108.00	0.07
O	水利、环境和公共设施管理业	88,186.79	0.20
P	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
Q	教育	0.00	0.00
R	卫生和社会工作	0.00	0.00
S	文化、体育和娱乐业	589,476.07	0.01
T	综合	800,526.06	2.26
	合计	36,989,134.82	97.29

7.2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	62,706.00	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	40,134.15	0.10
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	103,840.15	0.30

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601106	中国一重	23,809	454,037.63	1.10
2	601727	上海电气	19,463	442,588.62	1.07
3	600415	小商品城	24,820	422,188.20	1.02
4	600029	南方航空	30,375	367,513.75	0.87
5	600068	葛洲坝	21,183	306,670.69	0.74
6	600446	金证股份	1,456	302,363.55	0.73
7	600820	隧道股份	15,026	294,058.82	0.71
8	601179	中国西电	21,819	293,465.55	0.71
9	600219	南山铝业	20,589	276,716.16	0.67
10	600005	武钢股份	38,811	273,617.55	0.66

7.3.2积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600290	华仪电气	3,400	62,390.00	0.15
2	600575	皖江物流	9,765	40,134.15	0.10
3	603306	华懋科技	400	21,316.00	0.05

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	600660	福耀玻璃	545,790.00	2.40
2	600153	建发股份	421,989.00	1.85
3	601168	西部矿业	409,310.00	1.80
4	600029	南方航空	403,408.00	1.77
5	600755	厦门国贸	398,223.00	1.75
6	601991	大唐发电	385,683.00	1.69
7	600219	南山铝业	373,083.00	1.64
8	600415	小商品城	357,995.00	1.57
9	600881	亚泰集团	350,602.00	1.54
10	600068	葛洲坝	342,643.00	1.51
11	601179	中国西电	339,007.00	1.49
12	600867	通化东宝	338,241.00	1.49
13	600399	抚顺特钢	326,829.00	1.44
14	600138	中青旅	325,734.17	1.43
15	600388	龙净环保	323,559.00	1.41
16	600410	华胜天成	315,818.00	1.39
17	600642	申能股份	309,180.00	1.36
18	600008	首创股份	302,117.00	1.33
19	601333	广深铁路	298,916.00	1.31
20	601106	中国一重	296,669.00	1.30

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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	600660	福耀玻璃	810,339.52	3.56
2	600153	建发股份	756,484.01	3.32
3	600029	南方航空	499,638.94	2.19
4	601168	西部矿业	474,538.27	2.08
5	600755	厦门国贸	441,006.22	1.94
6	601991	大唐发电	433,485.05	1.90
7	600415	小商品城	426,049.94	1.87
8	600068	葛洲坝	411,966.32	1.81
9	601106	中国一重	401,606.59	1.76
10	600881	亚泰集团	378,583.09	1.66
11	600410	华胜天成	371,951.09	1.63
12	600008	首创股份	369,295.85	1.62
13	601179	中国西电	363,938.52	1.60
14	601333	广深铁路	357,604.20	1.57
15	601727	上海电气	351,417.97	1.54
16	600388	龙净环保	347,288.97	1.53
17	600005	武钢股份	346,513.51	1.52
18	600642	申能股份	346,150.00	1.52
19	600138	中青旅	335,128.07	1.47
20	600811	东方集团	325,925.26	1.43

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	42,836,577.70
卖出股票收入（成交）总额	48,964,841.46

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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

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前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,521.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	204,471.07
5	应收申购款	1,189,225.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,419,218.30

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

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600575	皖江物流	40,134.15	0.10	重大事项停牌

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 投资组合报告(转型后)

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	44,910,258.61	71.54
	其中：股票	44,910,258.61	71.54
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	13,752,301.46	21.91
7	其他资产	4,116,587.14	6.56
8	合计	62,779,147.21	100.00

7.2 期末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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	111,800.57	0.19
C	制造业	30,543,257.27	52.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,032.96	0.05
E	建筑业	989.12	0.00
F	批发和零售业	5,372,473.45	9.22
G	交通运输、仓储和邮政业	140,174.49	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,153,044.83	3.70
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,139,613.68	1.96
L	租赁和商务服务业	89,585.48	0.15
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	5,218,562.00	8.96
R	文化、体育和娱乐业	87.51	0.00
S	综合	112,647.25	0.19
	合计	44,910,258.61	77.11

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

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	300147	香雪制药	69,100	2,128,280.00	3.65
2	300244	迪安诊断	25,000	2,098,500.00	3.60
3	600867	通化东宝	89,600	1,877,208.00	3.22
4	600420	现代制药	42,000	1,827,000.00	3.14
5	600812	华北制药	148,300	1,800,362.00	3.09
6	600621	华鸿药业	56,724	1,741,375.00	2.99
7	002022	科华生物	40,600	1,731,196.00	2.97
8	600479	千金药业	80,800	1,712,152.00	2.94
9	300015	爱尔眼科	52,400	1,690,424.00	2.90
10	002644	佛慈制药	31,100	1,564,378.00	2.67
11	300244	迪安诊断	2,494,382.85	4.28
12	300147	香雪制药	2,322,261.70	3.99
13	600420	现代制药	2,234,782.00	3.84
14	600479	千金药业	2,145,924.00	3.68
15	002022	科华生物	1,962,282.00	3.37
16	600687	刚泰控股	1,906,573.00	3.27
17	600812	华北制药	1,801,254.00	3.09
18	300015	爱尔眼科	1,784,274.26	3.06
19	300347	泰格医药	1,768,338.44	3.04
20	300041	回天新材	1,740,776.94	2.99
21	600867	通化东宝	1,733,612.20	2.98
22	600383	耆君姓	1,731,377.00	2.97
23	002644	佛慈制药	1,693,187.00	2.91
24	600521	华海药业	1,517,657.20	2.61
25	002462	嘉事堂	1,510,096.55	2.59
26	600702	沱牌舍得	1,420,736.50	2.44
27	600745	中闽股份	1,404,034.00	2.41
28	002556	辉隆股份	1,400,231.00	2.40
29	002758	华通医药	1,394,448.00	2.39
30	600422	昆药集团	1,389,462.00	2.39
31	600594	益佰制药	1,385,130.00	2.38
32	300140	启源装备	1,349,523.00	2.32
33	600056	华润万东	1,267,118.00	2.18

注：本报告期内，累计买入股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600422	昆药集团	1,385,618.59	2.38
2	601106	中国一重	478,380.00	0.82
3	601727	上海电气	456,789.68	0.78
4	600415	小商品城	434,346.80	0.75
5	300146	汤臣倍健	430,650.00	0.74
6	300246	宝莱特	411,521.00	0.71
7	600029	南方航空	380,871.00	0.65
8	600820	隧道股份	296,480.00	0.51
9	600068	葛洲坝	294,729.55	0.51
10	601179	中国西电	293,244.70	0.50
11	600446	金证股份	288,787.50	0.50
12	600219	南山铝业	275,053.02	0.47
13	601991	大唐发电	273,708.75	0.47
14	600642	申能股份	269,156.82	0.46
15	600635	大众公用	266,710.59	0.46
16	600005	武钢股份	266,630.58	0.46
17	600978	宜华木业	256,503.59	0.44
18	600881	亚泰集团	247,605.50	0.43
19	600867	通化东宝	246,594.40	0.42
20	601333	广深铁路	245,529.00	0.42

注：本报告期内，累计卖出股票金额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	50,212,569.12
卖出股票收入（成交）总额	35,042,513.77

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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

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前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11.3本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	25,521.53
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,076.71
5	应收申购款	4,033,871.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	54,117.60
8	其他	-
9	合计	4,116,587.14

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息(转型前)

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
1,413	15