

# 广发核心精选股票型证券投资基金

基金管理人、基金托管人、基金销售机构等存在虚假记载、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审议通过,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定,于2015年6月21日复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合情况等内容,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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

2015年6月20日

|            |                 |
|------------|-----------------|
| 基金基本情况     |                 |
| 基金简称       | 广发核心精选股票        |
| 基金主代码      | 270006          |
| 交易场所/方式    | 深圳证券交易所         |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2009年7月16日      |
| 基金管理人      | 广发基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司    |
| 报告期末基金份额总额 | 628,601,160.04份 |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

|        |                       |                                                                                                                                           |
|--------|-----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 2.2    | 基金产品描述                |                                                                                                                                           |
| 投资目标   |                       | 通过认真的研究和分析,合理运用债券、现金等资产,采用“核心-卫星”策略配置,投资于具有较高投资价值的项目,在利率合理预期的基础上,进行长期管理,使基金投资于债券市场,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。                               |
| 投资策略   |                       | 本基金采用“核心-卫星”的投资策略,在约80%的资产配置及具备充分分散中精选或重仓投资于国债、票据等,将约20%的资产配置于“核心股票”,本基金将重点投资于具有核心优势,直接受益于经济转型升级的上市公司。一般情况下,本基金持有的“核心股票”的市值不低于本基金总资产的20%。 |
| 投资风险提示 |                       | 本基金采用“核心-卫星”的投资策略,在约80%的资产配置及具备充分分散中精选或重仓投资于国债、票据等,将约20%的资产配置于“核心股票”,本基金将重点投资于具有核心优势,直接受益于经济转型升级的上市公司。一般情况下,本基金持有的“核心股票”的市值不低于本基金总资产的20%。 |
| 风险收益特征 |                       | 本基金为投资型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金。                                                                                        |
| 2.3    | 基金管理人和基金托管人           |                                                                                                                                           |
|        | 项目                    | 基金管理人<br>基金托管人                                                                                                                            |
|        | 名称                    | 广东基金管理有限公司<br>中银工商银行股份有限公司                                                                                                                |
|        | 信息 披露 负责 人            | 姓名<br>联系电话<br>电子邮箱<br>020-83930666<br>010-66186799<br>dx@fundsc.com<br>custody@icbc.com                                                   |
|        | 客户服务电话                | 96688<br>020-83999158<br>010-66186799                                                                                                     |
|        | 信息披露方式                |                                                                                                                                           |
|        | 载基金半年度报告摘要的基金管理人互联网网站 | http://www.gdfundsc.com                                                                                                                   |
|        | 基金半年度报告备置地点           | 广州市海珠区大道1号15楼国际大厦附楼31-33                                                                                                                  |

|                 |                           |           |
|-----------------|---------------------------|-----------|
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 3 主要财务指标和基金净值表现           | 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日至2015年6月30日) |           |

|               |                  |                  |       |
|---------------|------------------|------------------|-------|
| 本期已实现收益       |                  | 1,069,127,068.61 |       |
| 本期利润          |                  | 1,044,492,098.83 |       |
| 加权平均净资产收益率    |                  | 1.3060           |       |
| 本期基金份额净值增长率   |                  | 64.81%           |       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) |                  |       |
| 期末可供分配基金份额利润  |                  | 1,931,100,139.26 |       |
| 期末基金资产净值      |                  | 3,072            |       |
| 基金份额净值        |                  |                  | 3.072 |

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(不含公允价值变动损益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上公允价值变动损益。

2) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3) 期末基金份额净值及与同期净值比较收益的年化增长率

| 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   |
|-----------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一年      | -22.40%  | 4.36%       | -5.08%     | 2.80%         | -16.42% | 1.56% |
| 过去三个月     | 8.09%    | 3.57%       | 8.56%      | 2.09%         | -0.47%  | 1.48% |
| 过去六个月     | 64.81%   | 2.93%       | 21.81%     | 1.81%         | 43.00%  | 1.12% |
| 过去一年      | 73.36%   | 2.20%       | 36.36%     | 1.47%         | -12.99% | 0.73% |
| 过去三年      | 98.19%   | 1.70%       | 67.75%     | 1.19%         | 30.44%  | 0.51% |
| 自基金合同生效至今 | 251.68%  | 1.56%       | 51.81%     | 1.37%         | 199.87% | 0.19% |

注：①、②、③、④数据采用R平方为0.989%的R平方模型(R平方模型R平方>0.9)上回归得到。

2.收益比较是否是根据基金合同关于资产配置比例的规定而确定。

3.2.2 自基金合同生效以来,基金投资组合资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

友友核心精选股票型证券投资基金

(截至2016年7月16日,自2015年6月30日)

净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

图例: — 基金 — 业绩比较基准

4 管理人报告

[illegible][illegible][illegible][illegible]

同时编制资产负债表、所有者权益变动表及附注，并进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6

半年度财务报告（未经审计）

6.1 资产负债表

单位：人民币元

| 资产       | 本期末<br>2015年6月30日 | 上年期末<br>2014年12月31日 |
|----------|-------------------|---------------------|
| 资产：      |                   |                     |
| 货币       | --                | --                  |
| 银行存款     | 560,746,494.00    | 319,780,912.86      |
| 结算备付金    | 15,521,126.64     | 1,074,925.80        |
| 存出保证金    | 2,361,441.04      | 1,732,886.85        |
| 交易性金融资产  | 1,544,732,252.79  | 1,346,088,471.96    |
| 其中：股票投资  | 1,544,732,252.79  | 1,346,088,471.96    |
| 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   | --                | --                  |
| 买入返售金融资产 | --                | --                  |
| 应收证券清算款  | 21,307,620.52     | 42,549,274.41       |
| 应收利息     | 52,464.43         | 73,460.16           |
| 应收股利     | --                | --                  |
| 应收申购款    | 7,058,650.71      | 488,770.32          |
| 递延所得税资产  | --                | --                  |
| 其他资产     | --                | --                  |
| 资产总计     | 2,141,929,280.03  | 1,713,474,786.36    |

| 负债和所有者权益                                         | 本期末<br>2015年6月30日          | 上年度末<br>2014年12月31日             |
|--------------------------------------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 短期借款                                             | -                          | -                               |
| 应付账款                                             | -                          | -                               |
| 预收账款                                             | -                          | -                               |
| 应付职工薪酬                                           | -                          | -                               |
| 应交税费                                             | -                          | -                               |
| 应付利息                                             | -                          | -                               |
| 应付股利                                             | -                          | -                               |
| 其他应付款                                            | -                          | -                               |
| 其他流动负债                                           | -                          | -                               |
| 负债合计                                             | -                          | -                               |
| 所有者权益                                            | -                          | -                               |
| 实收资本                                             | 64,297,522.43              | 36,417,064.11                   |
| 资本公积                                             | 127,780,403.63             | 12,589,696.00                   |
| 盈余公积                                             | -                          | -                               |
| 未分配利润                                            | 5,437,033.04               | 2,263,760.00                    |
| 所有者权益合计                                          | 173,077,926.07             | 49,266,460.11                   |
| 负债和所有者权益总计                                       | 173,077,926.07             | 49,266,460.11                   |
| 截至2015年10月15日止,基金初始净值为人民币0.702元,基金初始净值为人民币1.00元。 |                            |                                 |
| 报告期末:2015年1月1日至2015年6月30日                        |                            |                                 |
| 单位:人民币元                                          |                            |                                 |
| 资产                                               | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
| 一、收入                                             | 1,082,079,506.07           | -361,799,211.87                 |
| 1. 利息收入                                          | 878,440.08                 | 1,706,047.26                    |
| 其中:存款利息收入                                        | 878,440.08                 | 1,706,047.26                    |
| 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. 公允价值变动收益                                      | 1,102,100,186.53           | -0.084,607.96                   |
| 其中:股票投资收益                                        | 1,103,100,224.52           | -21,760,067.35                  |
| 债券投资收益                                           | -                          | -                               |
| 资产支持证券投资收益                                       | -                          | -                               |
| 其他投资收益                                           | -                          | -                               |
| 3. 汇兑收益                                          | 2,189,974.01               | 12,676,440.42                   |
| 4. 以公允价值计量的资产(损失以“-”号填列)                         | -14,634,066.78             | -866,639,646.42                 |
| 5. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)                           | 3,644,013.14               | 2,219,013.21                    |
| 其中:公允价值变动收益                                      | 47,585,601.14              | 29,576,525.94                   |
| 6. 其他收入                                          | 45,387,540.23              | 22,336,561.06                   |
| 二、扣费                                             | 2,831,266.67               | 3,722,507.30                    |
| 1. 管理费                                           | -                          | -                               |
| 2. 托管费                                           | -                          | -                               |
| 3. 销售服务费                                         | -                          | -                               |
| 4. 其他费用                                          | 27,566,006.39              | 11,311,274.90                   |
| 三、利息支出                                           | -                          | -                               |
| 四、公允价值变动资产支出                                     | -                          | -                               |
| 五、其他资产                                           | 211,797.36                 | 209,369.85                      |
| 六、其他损益(净收益以“-”号填列)                               | 1,044,462,965.83           | -880,379,527.81                 |
| 七、其他资产(净收益以“-”号填列)                               | 1,044,462,965.83           | -880,379,527.81                 |
| 八、其他资产(净收益以“-”号填列)                               | -                          | -                               |
| 九、其他资产(净收益以“-”号填列)                               | -                          | -                               |
| 十、其他资产(净收益以“-”号填列)                               | -                          | -                               |
| 十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 二十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 二十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 二十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 三十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 三十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 四十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 四十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 五十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 五十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 六十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 六十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 七十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 七十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 八十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 八十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |
| 九十一、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十二、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十三、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十四、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十五、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十六、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十七、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十八、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 九十九、其他资产(净收益以“-”号填列)                             | -                          | -                               |
| 一百、其他资产(净收益以“-”号填列)                              | -                          | -                               |

| 项目                               | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                   |
|----------------------------------|----------------------------|-------------------|
|                                  | 实收基金                       | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                  | 898,088,050.06             | 705,157,654.69    |
| 二、本期经营业绩变动（基金净值变动）（本期利润）         | -                          | 1,044,432,955.62  |
| 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动（净申购或赎回）      | -257,438,906.12            | -764,638,566.23   |
| 其中：1.基金申购款                       | 777,527,290.87             | 1,518,906,290.71  |
| 2.基金赎回款                          | -985,024,185.09            | -2,026,606,090.92 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净利润减少） | -                          | -3,011,084,246.81 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                  | 628,601,143.94             | 1,302,484,994.41  |
| 2014年1月1日至2014年6月30日             |                            |                   |
| 项目                               | 实收基金                       | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                  | 2,016,129,902.24           | 2,005,702,613.17  |
| 二、本期经营业绩变动（基金净值变动）（本期利润）         | -                          | -399,579,527.81   |
| 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动（净申购或赎回）      | -655,827,433.31            | -644,214,524.94   |
| 其中：1.基金申购款                       | 361,797,916.58             | 347,317,600.01    |
| 2.基金赎回款                          | -1,007,534,626.89          | -991,522,014.56   |
| 四、本期向基金份额持有人分配                   | -                          | -1,069,065,641.84 |

[illegible][illegible]

| 在权益下 权益工具                                                                                                                                                                                                                       |               |                      |              |                       |   |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------------|--------------|-----------------------|---|
| <p>本基金报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易而进行的不公允价值交易。</p> <p>18.1.3 应支付关联方的佣金</p> <p>单位：人民币元</p>                                                                                                                                              |               |                      |              |                       |   |
| 关联方名称                                                                                                                                                                                                                           | 本期            |                      |              |                       |   |
|                                                                                                                                                                                                                                 | 当期佣金          | 占当期佣金总额的比例           | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金总额的比例          |   |
| 广发证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                      | 163,316,222   | 0.06%                | 30,626,600   | 0.22%                 |   |
| 关联方名称                                                                                                                                                                                                                           | 上年度可比期间       |                      |              |                       |   |
|                                                                                                                                                                                                                                 | 当期佣金          | 占当期佣金总额的比例           | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金总额的比例          |   |
| 广发证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                      | 208,772,200   | -                    | -            | -                     | - |
| <p>2、基金管理人及基金托管人应支付佣金、股票交易佣金、融资融券一揽子服务、估值咨询及资产管理费、交易所。</p> <p>本基金与关联方交易主要是在证券市场内通过一般经纪商进行。</p> <p>基金管理人及基金托管人应支付佣金及融资融券一揽子服务、估值咨询及资产管理费、交易所。该类佣金协议条款符合规范且在报告期内应支付佣金或支付与本基金份额的净值无关。</p>                                          |               |                      |              |                       |   |
| 18.2 关联方交易                                                                                                                                                                                                                      |               |                      |              |                       |   |
| 18.2.1 基金管理费                                                                                                                                                                                                                    |               |                      |              |                       |   |
| 项目                                                                                                                                                                                                                              | 单位：人民币元       |                      |              |                       |   |
|                                                                                                                                                                                                                                 | 本期            | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间      | 2014年7月1日至2014年12月31日 |   |
| 当期发生的基金应支付的管理费                                                                                                                                                                                                                  | 16,367,540.72 | 16,367,540.72        | 22,26,582.09 | 22,26,582.09          |   |
| 其中：支付销售机构的手续费/申购费                                                                                                                                                                                                               | 2,399,330.02  | 2,399,330.02         | 2,942,456.25 | 2,942,456.25          |   |
| <p>本基金管理费的计提日的基础资产净值的1.5%的年费率计提。计提方法如下：</p> <p>1.8.2.1.1 每日计提</p> <p>每日应计提的基金管理费</p> <p>基金管理费=基金净资产×年管理费率÷当年天数</p> <p>基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起向基金管理人一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。</p> |               |                      |              |                       |   |
| 18.2.1.2 基金托管费                                                                                                                                                                                                                  |               |                      |              |                       |   |

| 项目                                                                                                                                                                                                  | 本期                   |                      | 上年度可比期间 | 单位:人民币元 |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|----------------------|---------|---------|
|                                                                                                                                                                                                     | 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                                                                                                                                                                                      | 2,831,266.67         | 3,722,597.30         |         |         |
| 基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提,计算公式如下:<br>基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数<br>每日计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷365<br>本基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核确认后于次月首日起10个工作日内从基金财产中按照指定的账户和金额支付。 |                      |                      |         |         |
| 1.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易                                                                                                                                                                       |                      |                      |         |         |
| 1.3.4 与关联方进行国债回购交易                                                                                                                                                                                  |                      |                      |         |         |
| 1.3.5 与关联方进行银行定期存款及协议存款                                                                                                                                                                             |                      |                      |         |         |
| 1.3.6 与关联方进行支付结算                                                                                                                                                                                    |                      |                      |         |         |
| 1.3.7 与关联方进行权证交易                                                                                                                                                                                    |                      |                      |         |         |
| 1.3.8 与关联方进行股指期货交易                                                                                                                                                                                  |                      |                      |         |         |
| 1.3.9 与关联方进行融资融券交易                                                                                                                                                                                  |                      |                      |         |         |
| 1.3.10 与关联方进行资产支持证券交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.11 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.12 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.13 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.14 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.15 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.16 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.17 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.18 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.19 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.20 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.21 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.22 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.23 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.24 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.25 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.26 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.27 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.28 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.29 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.30 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.31 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.32 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.33 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.34 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.35 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.36 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.37 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.38 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.39 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.40 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.41 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.42 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.43 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.44 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.45 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.46 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.47 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.48 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.49 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.50 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.51 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.52 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.53 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.54 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.55 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.56 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.57 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.58 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.59 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.60 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.61 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.62 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.63 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.64 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.65 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.66 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.67 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.68 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.69 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.70 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.71 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.72 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.73 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.74 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.75 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.76 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.77 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.78 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.79 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.80 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.81 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.82 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.83 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.84 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.85 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.86 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.87 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.88 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.89 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.90 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.91 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.92 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.93 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.94 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.95 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.96 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.97 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.98 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.99 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                               |                      |                      |         |         |
| 1.3.100 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.101 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.102 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.103 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.104 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.105 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.106 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.107 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.108 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.109 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.110 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.111 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.112 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.113 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.114 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.115 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.116 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.117 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.118 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.119 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.120 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.121 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.122 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.123 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.124 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.125 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.126 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.127 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.128 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.129 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.130 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.131 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.132 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.133 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.134 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.135 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.136 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.137 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.138 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.139 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.140 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.141 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.142 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.143 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.144 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.145 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.146 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.147 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.148 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.149 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.150 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.151 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.152 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.153 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.154 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.155 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.156 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.157 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.158 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.159 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.160 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.161 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.162 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.163 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.164 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.165 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.166 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.167 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.168 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.169 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.170 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.171 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.172 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.173 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.174 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.175 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.176 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.177 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.178 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.179 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.180 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.181 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.182 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.183 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.184 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.185 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.186 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.187 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.188 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.189 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.190 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.191 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.192 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.193 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.194 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.195 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.196 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.197 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.198 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.199 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.200 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.201 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.202 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.203 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.204 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.205 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.206 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.207 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.208 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.209 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.210 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.211 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.212 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.213 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.214 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.215 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.216 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.217 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.218 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.219 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.220 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.221 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.222 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.223 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.224 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.225 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.226 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.227 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.228 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.229 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.230 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.231 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.232 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.233 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.234 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.235 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.236 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.237 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.238 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.239 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.240 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.241 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.242 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.243 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.244 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.245 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.246 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.247 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.248 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.249 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.250 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.251 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.252 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.253 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.254 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.255 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.256 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.257 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.258 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.259 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.260 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.261 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.262 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.263 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.264 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.265 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.266 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.267 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.268 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.269 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.270 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.271 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.272 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.273 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.274 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.275 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.276 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.277 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.278 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.279 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.280 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.281 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.282 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.283 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.284 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.285 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.286 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.287 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.288 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.289 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.290 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.291 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |
| 1.3.292 与关联方进行其他金融工具交易                                                                                                                                                                              |                      |                      |         |         |

[illegible]

不以公允价值计量的金融工具

对于不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括应收账款和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

公允价值计量的金融资产和金融负债

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。公允价值计量的金融资产与金融负债根据对于金融资产具有重大意义的最低级别的输入值确定公允价值并划分为以下三个层次：

2019年12月31日，本集团有以公允价值计量的金融资产工具具有如下公允价值：1,061,326,388.74元，属于第一层次的金融资产为1,061,326,388.74元，2019年12月31日时点，第一层次：1,061,326,388.74元，第二层次：0元，第三层次：0元。

2019年所属期间损益的重大变动

公允价值变动损益主要来源于：公允价值变动损益，交易不通过金融资产的损益变动，源于资产公允价值的变动。公允价值变动于交易发生期间确认，交易不通过损益且其他综合收益核算的不包括公允价值变动的金融资产，公允价值变动计入其他综合收益。公允价值变动损益的变动金额和公允价值变动损益的公允价值变动损益，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值变动损益计入当期损益。

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | 1,544,732,282.29 | 72.12            |
|    | 其中:股票             | 1,544,732,282.29 | 72.12            |
| 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      | 566,566,820.54   | 26.45            |
| 7  | 其他各项资产            | 30,630,176.70    | 1.43             |
| 8  | 合计                | 2,141,929,289.03 | 100.00           |

|    |                   | 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               | 580,654,701.28   | 30.07        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业  | --               | --           |
| E  | 建筑业               | 24,572,109.90    | 1.27         |
| F  | 批发和零售业            | --               | --           |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业       | 306,856,500.02   | 15.90        |
| H  | 住宿和餐饮业            | --               | --           |
| I  | 信息技术传输、软件和信息技术服务业 | 370,206,565.03   | 19.17        |
| J  | 金融业               | 29,419,047.00    | 1.52         |
| K  | 房地产业              | 51,601,280.00    | 2.67         |
| L  | 租赁和商务服务业          | 150,280,750.65   | 7.78         |
| 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         | 29,142,207.30    | 1.51         |
| S  | 综合                | --               | --           |
|    | 合计                | 1,544,732,202.79 | 79.95        |

| 北京中农大农业生物技术股份有限公司对外投资的子公司对外投资的子公司 |        |      |           |                | 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<br>(%) |
| 1                                 | 002183 | 怡和港通 | 2,284,547 | 109,280,790.66 | 7.79%            |
| 2                                 | 601111 | 中国国航 | 6,542,200 | 106,601,100.00 | 5.47%            |
| 3                                 | 600116 | 东方航空 | 8,202,364 | 101,161,924.48 | 5.24%            |
| 4                                 | 600029 | 南方航空 | 6,983,471 | 102,103,469.34 | 6.26             |
| 5                                 | 300431 | 暴风科技 | 402,963   | 85,204,411.85  | 4.14%            |
| 6                                 | 600936 | 天力   | 1,549,368 | 77,126,407.69  | 3.99             |
| 7                                 | 600828 | 上海机场 | 1,999,401 | 69,297,698.04  | 3.35             |
| 8                                 | 300156 | 安硕信息 | 1,320,588 | 52,808,802.72  | 2.56             |
| 9                                 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,198,260 | 52,836,020.40  | 2.56             |
| 10                                | 600638 | 云南白药 | 509,402   | 51,710,743.04  | 2.60             |

上述股票持有方不是以基金管理人基金投资的所有股票清单,但上述股票持有方是基金管理人投资的所有证券持有方。上述股票持有方不是以基金管理人基金投资的所有股票清单,但上述股票持有方是基金管理人投资的所有证券持有方。

| 累计买入金额占期初基金资产净值2%或20%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                          | 002106 | 特变电工  | 179,892,389.72 | 10.63          |
| 2                          | 000670 | 恒立实业  | 164,716,714.74 | 9.98           |
| 3                          | 301118 | 中钢国际  | 163,057,127.09 | 9.87           |
| 4                          | 002867 | 新瀚新材  | 162,650,213.38 | 9.85           |
| 5                          | 000446 | 中国宝安  | 141,911,180.12 | 8.60           |
| 6                          | 601888 | 华泰证券  | 137,047,062.02 | 8.36           |
| 7                          | 002280 | 金风科技  | 136,432,486.75 | 8.32           |
| 8                          | 600048 | 保利地产  | 128,358,314.31 | 7.77           |
| 9                          | 002482 | 惠胜新材  | 126,638,879.98 | 7.61           |
| 10                         | 002028 | 上海绿庭  | 110,312,638.38 | 6.82           |
| 11                         | 600662 | 国新文化  | 116,880,513.63 | 7.08           |
| 12                         | 300028 | 金信科技  | 116,348,433.98 | 7.05           |
| 13                         | 002083 | 恒信东方  | 114,224,627.68 | 6.99           |
| 14                         | 601111 | 中国铝业  | 113,115,721.25 | 6.92           |
| 15                         | 000948 | 南京医药  | 107,922,288.12 | 6.54           |
| 16                         | 000838 | 内蒙古电力 | 107,061,440.83 | 6.52           |
| 17                         | 003080 | 同力水泥  | 100,391,202.61 | 6.44           |
| 18                         | 002280 | 联联互动  | 100,566,420.02 | 6.33           |
| 19                         | 300431 | 盛通股份  | 100,303,542.02 | 6.11           |
| 20                         | 601015 | 交通银行  | 92,525,125.64  | 5.63           |
| 21                         | 300623 | 广联软件  | 98,849,748.93  | 5.97           |
| 22                         | 000629 | 中航航空  | 97,464,280.76  | 5.90           |
| 23                         | 301377 | 三友联众  | 96,206,203.08  | 5.85           |
| 24                         | 300262 | 三友网络  | 94,820,550.32  | 5.74           |
| 25                         | 000076 | 新希望   | 91,462,219.24  | 5.54           |
| 26                         | 000605 | 湖北广电  | 90,981,983.93  | 5.51           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 27 | 601106 | 兴利银行 | 85,798,841.12 | 6.07 |
| 28 | 002386 | 大北农  | 82,329,469.81 | 4.90 |
| 29 | 003107 | 世纪华联 | 79,142,482.84 | 4.67 |
| 30 | 003852 | 老百姓  | 76,006,350.95 | 4.65 |
| 31 | 300254 | 朗科存储 | 74,075,478.00 | 4.49 |
| 32 | 002284 | 金亚科技 | 73,311,381.88 | 4.44 |
| 33 | 003074 | 瀚宇博陆 | 72,525,427.34 | 4.30 |
| 34 | 000983 | 金通灵  | 71,881,011.93 | 4.30 |
| 35 | 000626 | 华鲁恒升 | 69,580,589.77 | 4.15 |
| 36 | 601386 | 华信能源 | 66,721,218.95 | 4.04 |
| 37 | 300313 | 翔丰港  | 64,238,767.67 | 3.89 |
| 38 | 003070 | 金亚科技 | 61,392,380.14 | 3.85 |
| 39 | 002163 | 石城药业 | 61,896,387.28 | 3.76 |
| 40 | 003252 | 科达生物 | 61,638,921.04 | 3.73 |
| 41 | 006621 | 华信能源 | 61,568,720.72 | 3.73 |
| 42 | 003066 | 德康国际 | 61,362,290.30 | 3.72 |
| 43 | 003026 | 众科科技 | 61,132,391.93 | 3.70 |
| 44 | 002272 | 众科科技 | 60,656,610.00 | 3.67 |
| 45 | 000636 | 中航机电 | 57,823,077.28 | 3.50 |
| 46 | 002246 | 中航机电 | 57,790,013.02 | 3.50 |
| 47 | 005653 | 中航机电 | 57,141,387.40 | 3.46 |
| 48 | 300288 | 华信生物 | 56,347,540.00 | 3.41 |
| 49 | 002146 | 康美药业 | 56,037,856.52 | 3.40 |
| 50 | 000086 | 中兴通讯 | 55,483,962.75 | 3.38 |
| 51 | 300130 | 新华医疗 | 56,233,228.38 | 3.34 |
| 52 | 003663 | 科达生物 | 52,976,162.11 | 3.24 |
| 53 | 002655 | 普利股份 | 53,283,818.66 | 3.23 |
| 54 | 300480 | 中航科技 | 52,653,474.40 | 3.10 |
| 55 | 000422 | 华信能源 | 52,572,760.00 | 3.09 |
| 56 | 300087 | 东方雨虹 | 52,281,573.28 | 3.17 |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 57 | 002866 | 欧普光电   | 51,300,079.00 | 3.11 |
| 58 | 001188 | 东方明珠   | 51,223,003.00 | 3.10 |
| 59 | 000763 | 通威医疗   | 50,812,080.00 | 3.09 |
| 60 | 000089 | 中信海直   | 50,794,176.11 | 3.07 |
| 61 | 002211 | 宏达新材   | 50,136,137.40 | 3.07 |
| 62 | 000638 | 云南白药   | 50,054,942.78 | 3.06 |
| 63 | 000276 | 恒顺醋业   | 49,344,021.96 | 2.96 |
| 64 | 001001 | 海螺水泥   | 49,215,394.78 | 2.96 |
| 65 | 000078 | 南京控股   | 48,798,117.29 | 2.94 |
| 66 | 000308 | 喜临门    | 46,641,229.86 | 2.87 |
| 67 | 000826 | 华信国际   | 46,001,297.98 | 2.82 |
| 68 | 000016 | 厦门股份   | 44,638,025.20 | 2.75 |
| 69 | 000015 | 华夏银行   | 44,464,948.38 | 2.69 |
| 70 | 001028 | 华信能源   | 44,226,727.68 | 2.68 |
| 71 | 022251 | 步步高    | 43,604,194.65 | 2.64 |
| 72 | 022266 | 顺祥纺织   | 42,616,786.79 | 2.56 |
| 73 | 000619 | 中信证券   | 42,400,380.92 | 2.56 |
| 74 | 000678 | 烟台冰厂   | 42,223,681.12 | 2.55 |
| 75 | 300369 | 金通教育   | 41,019,642.67 | 2.48 |
| 76 | 001046 | 华信国际   | 40,400,958.53 | 2.44 |
| 77 | 000001 | 万科A    | 38,401,027.84 | 2.33 |
| 78 | 300017 | 网科科技   | 38,226,666.68 | 2.33 |
| 79 | 000430 | 华信国际   | 37,724,510.94 | 2.32 |
| 80 | 301016 | 安诺亚    | 37,660,369.94 | 2.32 |
| 81 | 000660 | "ST"古汉 | 37,330,407.78 | 2.29 |
| 82 | 002212 | 宏达新材   | 37,243,727.98 | 2.29 |
| 83 | 001029 | 建信股份   | 37,222,364.48 | 2.29 |
| 84 | 001818 | 光大银行   | 37,199,040.31 | 2.28 |
| 85 | 000778 | 东信国际   | 37,136,001.18 | 2.28 |
| 86 | 600252 | 中国铝业   | 36,867,106.32 | 2.26 |
| 87 | 600580 | 东方金立   | 36,837,766.36 | 2.25 |
| 88 | 000860 | 东方明珠   | 36,892,416.66 | 2.23 |
| 89 | 300419 | 浩鑫科技   | 35,269,420.95 | 2.14 |
| 90 | 001328 | 华信国际   | 34,861,177.98 | 2.11 |
| 91 | 000288 | 华信国际   | 34,427,427.78 | 2.09 |
| 92 | 300069 | 东方明珠   | 33,407,413.00 | 2.02 |

| 买入股票前十大 |        |      |                | 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       | 占期初买入金额的<br>比例(%) |
| 1       | 000001 | 平安银行 | 257,367,139.02 | 1.38              |
| 2       | 001318 | 中国平安 | 100,900,970.59 | 1.18              |
| 3       | 000046 | 金发科技 | 257,367,139.02 | 1.71              |
| 4       | 000002 | 万科A  | 100,704,468.32 | 1.18              |
| 5       | 000030 | 安泰集团 | 185,675,670.81 | 1.42              |
| 6       | 000827 | 中金黄金 | 176,798,479.81 | 1.05              |
| 7       | 000020 | 深发展  | 177,282,113.57 | 10.31             |
| 8       | 000048 | 保利地产 | 145,465,151.25 | 10.02             |
| 9       | 002652 | 嘉事堂  | 164,400,586.21 | 9.92              |
| 10      | 001688 | 华泰证券 | 125,557,166.64 | 8.45              |
| 11      | 002280 | 联环药业 | 137,661,850.31 | 8.34              |
| 12      | 002196 | 三药集团 | 127,838,589.90 | 7.74              |
| 13      | 002026 | 山东钢铁 | 128,140,006.04 | 7.64              |
| 14      | 600636 | 三钢闽光 | 118,156,728.87 | 7.16              |
| 15      | 000948 | 南京高科 | 115,327,024.97 | 6.88              |
| 16      | 001377 | 华信国际 | 112,227,711.46 | 6.88              |
| 17      | 000440 | 天华股份 | 106,261,461.57 | 6.43              |
| 18      | 000430 | 大港股份 | 103,898,330.91 | 6.29              |
| 19      | 000070 | 华安医药 | 91,701,343.34  | 5.48              |
| 20      | 300087 | 东方雨润 | 97,064,808.68  | 5.88              |
| 21      | 000626 | 长安汽车 | 96,206,079.65  | 5.83              |
| 22      | 001106 | 华信国际 | 93,600,433.67  | 5.73              |
| 23      | 002038 | 大地牧业 | 93,382,123.86  | 5.66              |
| 24      | 002036 | 大农国际 | 91,721,342.46  | 5.56              |
| 25      | 002183 | 海泰股份 | 91,550,362.77  | 5.56              |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 26 | 300263 | 蓝光软件 | 87.530,16801 | 5.30 |
| 27 | 300240 | 华信新材 | 86.882,04828 | 5.26 |
| 28 | 300280 | 豪派新材 | 85.280,4918  | 5.17 |
| 29 | 300170 | 汉得信息 | 81.832,46676 | 4.96 |
| 30 | 300272 | 美利信  | 81.261,21513 | 4.95 |
| 31 | 300382 | 爱朋   | 81.006,49028 | 4.93 |
| 32 | 300013 | 新大陆  | 77.803,41419 | 4.72 |
| 33 | 300280 | 荣科科技 | 77.230,23464 | 4.68 |
| 34 | 300254 | 美迪凯  | 70.633,70325 | 4.66 |
| 35 | 300683 | 中恒电力 | 74.094,08474 | 4.40 |
| 36 | 300226 | 华创云信 | 74.001,52793 | 4.40 |
| 37 | 300266 | 金通灵  | 71.152,61356 | 4.37 |
| 38 | 000616 | 国际医学 | 69.260,53097 | 4.10 |
| 39 | 300138 | 华信医药 | 66.872,43157 | 3.98 |
| 40 | 002266 | 福龙马  | 66.662,19838 | 3.96 |
| 41 | 300286 | 三生生物 | 66.528,04688 | 3.97 |
| 42 | 300359 | 金富药业 | 64.002,38972 | 3.88 |
| 43 | 001310 | 华信新材 | 63.851,89435 | 3.73 |
| 44 | 000852 | 浙江龙盛 | 61.538,40049 | 3.73 |
| 45 | 002251 | 步步高  | 59.748,76306 | 3.62 |
| 46 | 000678 | 华信新材 | 59.083,02877 | 3.61 |
| 47 | 601280 | 华信新材 | 59.210,28462 | 3.56 |
| 48 | 000925 | 众科科技 | 57.893,44637 | 3.51 |
| 49 | 601138 | 华信新材 | 57.857,20003 | 3.56 |
| 50 | 300033 | 同益新材 | 56.945,39722 | 3.40 |
| 51 | 600015 | 华信新材 | 56.005,00032 | 3.40 |
| 52 | 000667 | 华信新材 | 55.067,63833 | 3.34 |
| 53 | 002094 | 华信新材 | 54.446,73819 | 3.30 |
| 54 | 000793 | 华信新材 | 50.905,08246 | 3.09 |
| 55 | 001106 | 华信新材 | 50.051,30432 | 3.09 |
| 56 | 000308 | 华信新材 | 49.194,08356 | 2.92 |
| 57 | 002177 | 华信新材 | 47.506,50632 | 2.98 |
| 58 | 000711 | 华信新材 | 47.207,76768 | 2.98 |
| 59 | 000101 | 方正证券 | 47.231,04751 | 2.98 |
| 60 | 600016 | 方正证券 | 46.406,22808 | 2.82 |
| 61 | 000006 | 华信新材 | 45.261,91788 | 2.81 |
| 62 | 000222 | 华信新材 | 46.140,41455 | 2.79 |
| 63 | 002266 | 华信新材 | 46.119,79826 | 2.79 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 64 | 002400 | 蜜特股份 | 40,749,618.66 | 2.77 |
| 65 | 601030 | 宏信股份 | 45,528,220.73 | 2.76 |
| 66 | 002315 | 思立科技 | 46,510,138.06 | 2.76 |
| 67 | 603038 | 长盛轴承 | 47,127,624.42 | 2.74 |
| 68 | 300256 | 惠科药业 | 46,085,817.67 | 2.73 |
| 69 | 000061 | 顺络股份 | 44,886,628.27 | 2.72 |
| 70 | 012852 | 中集集团 | 51,327,133.61 | 2.68 |
| 71 | 000039 | 中航集团 | 44,038,973.72 | 2.67 |
| 72 | 600016 | 厦工股份 | 43,686,256.24 | 2.66 |
| 73 | 007073 | 华信股份 | 43,083,294.19 | 2.61 |
| 74 | 000411 | 广汇股份 | 43,784,792.84 | 2.60 |
| 75 | 601028 | 华信股份 | 42,801,448.13 | 2.59 |
| 76 | 002312 | 中集集团 | 42,253,493.31 | 2.56 |
| 77 | 002294 | 信立泰  | 41,890,166.62 | 2.52 |
| 78 | 000705 | 中航集团 | 41,312,108.73 | 2.51 |
| 79 | 000722 | 湖北发展 | 40,739,527.11 | 2.47 |
| 80 | 300017 | 同洲科技 | 40,442,545.98 | 2.46 |
| 81 | 000346 | 中航集团 | 40,100,271.69 | 2.45 |
| 82 | 000024 | 招商地产 | 39,846,642.58 | 2.41 |
| 83 | 600950 | 华信集团 | 38,828,241.74 | 2.38 |
| 84 | 000420 | 中航集团 | 38,145,077.67 | 2.37 |
| 85 | 000063 | 大成燃气 | 38,081,386.63 | 2.35 |
| 86 | 300104 | 华信集团 | 37,836,077.96 | 2.30 |
| 87 | 601011 | 中航集团 | 37,726,138.00 | 2.29 |
| 88 | 600422 | 华信集团 | 37,560,130.27 | 2.27 |
| 89 | 601128 | 华信集团 | 37,410,000.27 | 2.27 |
| 90 | 000272 | 中航集团 | 39,642,544.43 | 2.26 |
| 91 | 300169 | 中航集团 | 34,712,770.54 | 2.10 |
| 92 | 000001 | 平安银行 | 33,702,082.10 | 2.04 |

|        |                                                         | 金额单位：人民币        |
|--------|---------------------------------------------------------|-----------------|
| 1      | 买入股票的成本（成交）总额                                           | 8,642,724.26113 |
| 2      | 卖出股票的收入（成交）总额                                           | 9,531,226.60004 |
| 3      | 期末按持仓品种分类的持仓投资组合                                        |                 |
| 3.1    | 本基金本报告期末未持有债券。                                          |                 |
| 3.2    | 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                          |                 |
| 3.3    | 本基金本报告期末未持有债券。                                          |                 |
| 3.4    | 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                      |                 |
| 3.5    | 本基金本报告期末未持有资产支持证券。                                      |                 |
| 3.6    | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细                         |                 |
| 3.7    | 本基金本报告期末未持有贵金属。                                         |                 |
| 3.8    | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名投资衍生品明细                         |                 |
| 3.9    | 本基金本报告期末未持有权证。                                          |                 |
| 3.10   | 期末未买入基金投资的股指期货交易情况说明                                    |                 |
| 3.11   | 本基金本报告期末未持有股指期货。                                        |                 |
| 3.12   | 报告期末本基金报告期内未进行国债期货交易。                                   |                 |
| 3.13   | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明                                    |                 |
| 3.14   | 本基金本报告期末未持有国债期货。                                        |                 |
| 3.15   | 报告期末本基金报告期内未进行国债期货交易。                                   |                 |
| 3.16   | 投资组合报告附注                                                |                 |
| 3.16.1 | 本基金投资的前十名投资主体在本报告期内没有出现过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。 |                 |
| 3.16.2 | 本基金投资的前十名股票的发行主体没有出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。                  |                 |

| 12月31期末其他各项资产构成 |         | 单位:人民币元       |
|-----------------|---------|---------------|
| 序号              | 名称      | 金额            |
| 1               | 存保保证金   | 3,161,444.04  |
| 2               | 应收存保清算款 | 21,357,620.52 |
| 3               | 应收股利    | —             |
| 4               | 应收利息    | 62,464.43     |
| 5               | 应收中间款   | 7,056,680.71  |
| 6               | 其他应收款   | —             |
| 7               | 待摊费用    | —             |
| 8               | 其他      | —             |
| 9               | 合计      | 30,630,176.01 |

期末未持有的处于转股期的可转换债券清单

本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

12. 期末前十名股票中存在被质押或冻结的情况说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 期末受限部分的公允价值    | 占基金资产净值比例(%) | 受限受冻结情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|-----------|
| 1  | 002183 | 纳亚通  | 150,280,790.65 | 7.78         | 重大事项      |
| 2  | 601111 | 中国铁航 | 69,591,106.00  | 3.47         | 重大事项      |
| 3  | 300433 | 暴風科技 | 86,294,411.85  | 4.41         | 重大事项      |
| 4  | 300156 | 安居宝  | 53,008,803.72  | 2.75         | 重大事项      |

8 基金申购赎回相关信息

|                        |                 |                |            |                |            |
|------------------------|-----------------|----------------|------------|----------------|------------|
| 1.期末基金份额持有人户数及持有结构     |                 | 份额单位：份         |            |                |            |
| 持有人户数(户)               | 户均持有的基金<br>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<br>例 | 持有份额           | 占总份额比<br>例 |
| 71,079                 | 8,843.70        | 170,835,599.36 | 27.18%     | 497,765,150.48 | 72.82%     |
| 2.期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 |                 |                |            |                |            |
| 持有基金份额的人<br>数(人)       | 持有基金份额<br>总额(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       | 127,660.03      | 0.0203%        |            |                |            |

| 项目                                   | 持有基金份额总额(万份) |
|--------------------------------------|--------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员<br>及其他人员持有本开放式基金 | 0            |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                      | 0            |

9 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2008年7月16日)基金份额总额 | 1,242,860,277.65 |
| 本报告期初前基金份额总额              | 898,088,066.06   |
| 本报告期基金总申购份额               | 727,537,260.07   |
| 减:本报告期基金总赎回份额             | 985,024,186.99   |
| 本报告期基金净申购份额               | -                |
| 本报告期末基金份额总额               | 625,601,150.84   |

10 重大事件揭示

- 基金持有人大会决议
- 报告期内未召开基金份额持有人大会。
- 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的大股东变更
- 自2015年4月30日起,包信生不再担任本基金管理人的副总经理。2015年6月23日,肖震不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已报中国证券业协会备案。
- 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
- 报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。
- 基金投资运作的重大变更
- 报告期内本基金的投资组合策略没有发生重大变化。
- 报告期内聘请会计师事务所情况
- 报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。
- 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
- 报告期内本基金的管理人、基金托管人、基金销售机构人员受到监管部门调查或处罚的情况。
- 基金租用证券公司交易席位的相关情况
- 中国证监会证券公司交易所进行股票及债券资金支付情况

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应付证券商佣金      |            | 备注   |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|------|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交金额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总额的比例 |      |
| 光大证券 | 3      | 989,079,719.24   | 5.44%        | 899,536.21   | 5.62%      |      |
| 国泰君安 | 4      | 952,100,279.18   | 5.24%        | 896,759.51   | 5.62%      |      |
| 中信证券 | 3      | 837,936,021.21   | 4.61%        | 762,772.62   | 4.72%      |      |
| 招商证券 | 3      | 769,297,128.00   | 4.22%        | 709,364.34   | 4.38%      |      |
| 银河证券 | 3      | 705,195,136.71   | 3.84%        | 699,288.43   | 4.18%      |      |
| 方正证券 | 6      | 695,025,919.12   | 3.82%        | 546,714.81   | 3.47%      | 新设一个 |
| 国海证券 | 1      | 620,870,910.73   | 3.42%        | 565,241.38   | 3.50%      |      |
| 华安证券 | 1      | 602,667,520.21   | 3.23%        | 429,164.06   | 2.68%      |      |
| 海通证券 | 2      | 514,932,887.20   | 2.83%        | 468,838.98   | 2.93%      |      |
| 东兴证券 | 2      | 468,602,534.46   | 2.51%        | 200,273.27   | 1.81%      |      |
| 首创证券 | 1      | 37,369,141.13    | 0.2%         | 34,040.24    | 0.21%      |      |
| 华福证券 | 2      | 367,852,782.16   | 2.02%        | 334,893.85   | 2.09%      |      |
| 西南证券 | 2      | 307,238,249.25   | 1.66%        | 279,700.69   | 1.76%      |      |
| 东方证券 | 2      | 300,588,363.58   | 1.65%        | 273,663.77   | 1.71%      |      |
| 中银建投 | 4      | 238,621,073.17   | 1.31%        | 217,240.55   | 1.36%      |      |
| 银河证券 | 3      | 2,307,458,504.81 | 12.70%       | 2,100,710.25 | 13.13%     |      |
| 中国银河 | 2      | 21,514,996.00    | 0.12%        | 15,497.29    | 0.10%      |      |

|       |   |                  |        |              |        |   |
|-------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 安信证券  | 5 | 1,975,513,865.11 | 10.87% | 1,798,506.71 | 11.24% | - |
| 平安证券  | 4 | 173,501,819.08   | 0.95%  | 123,256.39   | 0.77%  | - |
| 广发证券  | 7 | 168,064,040.48   | 0.93%  | 153,816.22   | 0.90%  | - |
| 中投证券  | 3 | 1,646,876,320.61 | 9.06%  | 1,498,408.12 | 9.37%  | - |
| 万联证券  | 2 | 162,442,900.05   | 0.89%  | 147,887.68   | 0.92%  | - |
| 国信证券  | 4 | 1,189,064,640.92 | 6.54%  | 1,082,526.48 | 6.77%  | - |
| 东海证券  | 1 | 1,114,336,589.36 | 6.13%  | 791,616.68   | 4.95%  | - |
| 长江证券  | 3 | 1,039,619,607.76 | 5.72%  | 946,489.39   | 5.92%  | - |
| 中农证券  | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中财证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 国联证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 浙商证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 兴业证券  | 4 | -                | -      | -            | -      | - |
| 齐鲁证券  | 3 | -                | -      | -            | -      | - |
| 首创证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 新时代证券 | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 瑞银证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 中银国际  | 3 | -                | -      | -            | -      | - |
| 国泰证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 华鑫证券  | 2 | -                | -      | -            | -      | - |
| 湘财证券  | 1 | -                | -      | -            | -      | - |

|        |   |    |    |    |    |      |
|--------|---|----|----|----|----|------|
| 东北证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 信达证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 联讯证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 厦门证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 西部证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 华泰证券   | 6 | -- | -- | -- | -- | 新增2个 |
| 国金证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 北京燕华   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 第一创业证券 | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 东莞证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 宏源证券   | 3 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 国元证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 野村证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 野村国际   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 川财证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 上海证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 中金公司   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 国都证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 江海证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 华融证券   | 1 | -- | -- | -- | -- | --   |
| 民生证券   | 2 | -- | -- | -- | -- | --   |

|          |   |    |    |    |    |
|----------|---|----|----|----|----|
| 英大证券     | 2 | -- | -- | -- | -- |
| 广州证券     | 2 | -- | -- | -- | -- |
| 渤海证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 中信证券（香港） | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 国信证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 东吴证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 南京证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 华宝证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 世纪证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |
| 长城证券     | 1 | -- | -- | -- | -- |

注：1、交易席位选择标准：  
 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；  
 经营行为规范，风险控制制度健全，在业内有良好的声誉；  
 具备融资融券所需的风险、安全、合规的硬件设施，并能积极配合进行证券交易的需要；  
 具有较稳定的研究行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场和个股的高品质报告，并能根据基金投资策略，提供有针对性的研究报告；  
 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；  
 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择程序：  
 公司对交易席位券商的服务质量进行评价，本基金管理人组织相关人员依据交易席位选择标准对交易单元候选券商的服务质量进行评估，并根据评估结果选择交易席位券商。

3、协议签署及席位托管：本基金管理人，与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

广发基金管理有限公司  
二〇一五年八月二十八日