

(上接B088版)

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期间直接购入关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项的说明。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的限售停牌等流通受限股票

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末 收盘价 (元) | 期初 收盘价 (元) | 数量 (股) | 期末 公允价值 (元) | 期初 公允价值 (元) |
|--------|------|------------|--------|------------------|------------------|---------------|-------------------|-------------------|
| 002274 | 华谊兄弟 | 2015-07-23 | 重大资产重组 | 85.00 | 85.00 | 40,496,378.00 | 40,425,300.00 | |
| 002402 | 明泰股份 | 2015-11-20 | 重大资产重组 | 25.00 | 20.00 | 23,516,545 | 32,438,338.00 | 30,471,766.00 |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

1)不以公允价值计量的金融资产

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

2)以公允价值计量的金融工具

(1)各层金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币724,625,477.61元,属于第二层次的余额为人民币79,261,756.53元,无属于第三层次余额。

于2014年12月31日,第一层次的余额为人民币39,183,567.17元,属于第二层次的余额为人民币5,188,850.00元,无属于第三层次余额。

(2)公允价值所属层次间重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复复牌日期间、交易不活跃期间及限售期间采用相关估值技术确定其公允价值。第一层次公允价值计量使用可观察输入值,第二层次公允价值计量使用可观察输入值以外的不可观察输入值。对于公允价值所属层次,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。根据中国证券投资基金业协会《中基协发〔2014〕24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月27日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种可采用摊余成本法估值(资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层次从第一层次转入第二层次。

(3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

2、承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

| 金额单位:人民币元 | | | | |
|-----------|-----------|------|------------------|------------|
| 序号 | 代码 | 项目名称 | 金额 | 占基金资产净值比例% |
| 1 | 股票投资 | | 803,572,433.14 | 77.22 |
| 2 | 债券投资 | | 803,572,433.14 | 77.22 |
| 3 | 资产支持证券 | | 304,800.00 | 0.03 |
| 4 | 买入返售金融资产 | | 304,800.00 | 0.03 |
| 5 | 其他资产 | | — | — |
| 6 | 负债及期末余额 | | — | — |
| 7 | 净资产/期末净资产 | | 1,042,749,666.28 | 100.00 |
| 8 | 净资产/期末净资产 | | 1,042,749,666.28 | 100.00 |

| 金额单位:人民币元 | | | | |
|-----------|------------------|----------------|------------|------------|
| 代码 | 行业名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例% | 占基金资产净值比例% |
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — | — |
| B | 采矿业 | — | — | — |
| C | 制造业 | 632,288,238.19 | 60.80 | — |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | — | — | — |
| E | 建筑业 | 90,000,000.00 | 8.63 | — |
| F | 批发零售业 | — | — | — |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | — | — | — |
| H | 住宿餐饮业 | — | — | — |
| I | 金融业 | 134,076,388.11 | 12.87 | — |
| J | 房地产业 | — | — | — |
| K | 租赁和商务服务业 | — | — | — |
| L | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 40,582,738.00 | 3.90 | — |
| M | 水利、环境和公共设施管理业 | — | — | — |
| N | 卫生和社会工作 | — | — | — |
| O | 文化、体育和娱乐业 | — | — | — |
| P | 综合 | — | — | — |
| Q | 合计 | 803,572,433.14 | 77.22 | — |

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过沪港通机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 |
| 1 | 000066 | 长城证券 | 2,330,000 | 57,867,000.00 |
| 2 | 000006 | 万科A | 910,000 | 57,270,900.00 |
| 3 | 300020 | 德赛电池 | 1,389,640 | 56,841,722.00 |
| 4 | 300085 | 银禧科技 | 1,000,200 | 53,760,240.00 |
| 5 | 300033 | 安硕信息 | 1,054,730 | 51,364,522.00 |
| 6 | 000045 | 深纺织A | 2,194,164 | 49,220,072.00 |
| 7 | 000026 | 赛微电子 | 1,378,440 | 49,200,884.00 |
| 8 | 300031 | 三创软件 | 1,570,000 | 48,750,000.00 |
| 9 | 000071 | 恒信移动 | 1,150,000 | 48,600,000.00 |
| 10 | 300039 | 鲁康药业 | 800,000 | 42,500,000.00 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人网站的中度报告正文。

8.4 报告期末股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 金额单位:人民币元 | | | | |
|-----------|--------|------|----------------|----------------|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
| 1 | 300253 | 卫宁健康 | 304,578,253.00 | 673.91 |
| 2 | 300265 | 三六五网 | 230,544,567.00 | 640.95 |
| 3 | 300289 | 蒙泰环保 | 215,053,577.32 | 474.42 |
| 4 | 300104 | 乐视网 | 190,400,874.00 | 420.03 |
| 5 | 002517 | 恒英药业 | 190,566,044.42 | 419.93 |
| 6 | 002405 | 国海证券 | 187,282,094.41 | 413.11 |
| 7 | 300378 | 康捷软件 | 181,681,757.16 | 400.80 |
| 8 | 002071 | 长城影视 | 165,048,070.24 | 364.10 |
| 9 | 002342 | 华孚色纺 | 163,340,670.00 | 360.34 |
| 10 | 300018 | 中元光电 | 160,627,000.00 | 354.27 |
| 11 | 300351 | 永贵电器 | 156,560,140.10 | 346.24 |
| 12 | 300038 | 梅泰诺 | 150,289,769.01 | 342.53 |
| 13 | 002188 | 巴士在线 | 154,770,210.00 | 341.43 |
| 14 | 300248 | 新开普 | 152,033,028.00 | 336.39 |
| 15 | 002707 | 众信旅游 | 145,003,186.79 | 319.88 |
| 16 | 002123 | 荣信股份 | 143,506,283.24 | 317.53 |
| 17 | 600670 | 恒生电子 | 143,680,874.19 | 316.97 |
| 18 | 300103 | 达瑞智能 | 140,454,420.08 | 310.29 |
| 19 | 300336 | 新文化 | 132,151,363.54 | 291.53 |
| 20 | 002084 | 鼎腾卫浴 | 127,148,688.05 | 280.50 |
| 21 | 300359 | 金通威 | 121,785,962.79 | 268.67 |
| 22 | 002235 | 安联股份 | 121,300,234.06 | 267.69 |
| 23 | 002657 | 中科金财 | 117,762,089.50 | 258.79 |
| 24 | 002113 | 天润科技 | 117,011,855.69 | 258.12 |
| 25 | 300026 | 天喻信息 | 116,836,146.57 | 257.75 |
| 26 | 300227 | 光韵达 | 115,165,854.05 | 254.06 |
| 27 | 300049 | 福耀股份 | 113,474,386.41 | 250.33 |
| 28 | 002651 | 尚荣医疗 | 112,033,102.49 | 247.15 |
| 29 | 300281 | 华录百纳 | 109,088,471.54 | 240.88 |
| 30 | 002502 | 神威股份 | 97,312,226.14 | 214.88 |
| 31 | 300078 | 思创医惠 | 96,311,574.58 | 212.47 |
| 32 | 300380 | 安联药业 | 91,964,480.03 | 202.88 |
| 33 | 300043 | 互动娱乐 | 83,309,324.75 | 185.15 |
| 34 | 600190 | 瑞茂通 | 82,610,013.00 | 182.24 |
| 35 | 600270 | 岱宗纸业 | 78,185,577.87 | 172.45 |
| 36 | 002694 | 蓝盾股份 | 77,118,853.10 | 170.13 |
| 37 | 600137 | 海钢股份 | 72,253,947.18 | 159.40 |
| 38 | 300123 | 华康药业 | 70,990,329.51 | 156.61 |
| 39 | 002254 | 天润科技 | 70,775,071.20 | 156.18 |
| 40 | 300320 | 新研股份 | 69,545,079.05 | 152.42 |
| 41 | 002256 | 荣科软件 | 67,569,369.05 | 149.12 |
| 42 | 300081 | 恒信移动 | 67,527,020.04 | 148.90 |
| 43 | 600418 | 江淮汽车 | 66,734,867.10 | 147.22 |
| 44 | 002516 | 旷达科技 | 64,313,658.05 | 141.89 |
| 45 | 600720 | 中国高科 | 63,965,396.00 | 141.09 |
| 46 | 300222 | 明润科技 | 61,086,151.59 | 134.76 |
| 47 | 600446 | 金证股份 | 59,462,011.00 | 131.18 |
| 48 | 002343 | 金亚传媒 | 59,351,639.28 | 130.93 |
| 49 | 002655 | 金地药业 | 58,673,277.50 | 128.88 |
| 50 | 300399 | 英夫利 | 57,129,784.25 | 126.03 |
| 51 | 600276 | 恒瑞医药 | 55,538,176.21 | 123.40 |
| 52 | 300486 | 东杰智能 | 54,960,029.90 | 121.24 |
| 53 | 300221 | 联信科技 | 54,954,625.58 | 121.23 |
| 54 | 002407 | 二六三 | 54,803,306.50 | 120.90 |
| 55 | 300033 | 同花顺 | 54,680,800.14 | 119.30 |
| 56 | 300059 | 东方财富 | 54,032,860.00 | 119.20 |
| 57 | 002208 | 威创股份 | 53,306,401.25 | 117.60 |
| 58 | 300031 | 宝通科技 | 53,299,416.77 | 117.58 |
| 59 | 002281 | 世纪股份 | 53,246,516.64 | 117.46 |
| 60 | 600083 | 博信股份 | 51,545,089.85 | 114.59 |
| 61 | 300194 | 中文在线 | 51,832,325.30 | 114.34 |
| 62 | 002429 | 光润股份 | 51,597,355.81 | 113.83 |
| 63 | 000958 | 东方财富 | 50,910,345.54 | 112.31 |
| 64 | 000802 | 北京文化 | 50,589,738.00 | 112.26 |
| 65 | 300352 | 宝信软件 | 50,259,299.00 | 110.87 |
| 66 | 002425 | 凯撒股份 | 49,855,747.11 | 109.95 |
| 67 | 300160 | 秀强股份 | 49,632,946.81 | 109.49 |
| 68 | 002117 | 东通股份 | 49,272,607.01 | 108.70 |
| 69 | 600006 | 联明股份 | 48,515,409.19 | 107.03 |
| 70 | 300347 | 泰格医药 | 47,689,269.22 | 106.20 |
| 71 | 300274 | 万泽科技 | 47,566,824.45 | 104.91 |
| 72 | 300211 | 亿通科技 | 46,589,800.87 | 102.80 |
| 73 | 600209 | 罗敏发展 | 45,531,396.63 | 101.33 |
| 74 | 300247 | 乐金电源 | 46,747,530.43 | 100.92 |
| 75 | 002152 | 广电运通 | 46,740,228.45 | 100.90 |
| 76 | 600088 | 赫门 | 44,715,727.74 | 98.64 |
| 77 | 300222 | 吴通控股 | 44,123,289.00 | 97.38 |
| 78 | 600288 | 柳州医药 | 43,580,566.27 | 96.14 |
| 79 | 601088 | 中国国旅 | 41,923,025.78 | 92.85 |
| 80 | 600420 | 现代制药 | 41,558,044.88 | 91.24 |
| 81 | 601059 | 华谊兄弟 | 40,518,332.93 | 89.39 |
| 82 | 002174 | 华翔路桥 | 40,556,278.05 | 89.37 |
| 83 | 300294 | 三聚环保 | 39,902,891.04 | 88.03 |
| 84 | 002127 | 新研科技 | 39,727,988.03 | 87.84 |

注:(1)“买入金额”按买入成交金额(成交金额乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。(2)根据上市公司公告,“泰亚股份”自2016年2月3日简称变更为“世英网络”。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 金额单位:人民币元 | | | | |
|-----------|--------|------|----------------|----------------|
| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
| 1 | 300253 | 卫宁健康 | 321,790,058.04 | 709.88 |
| 2 | 300266 | 三六五网 | 230,393,999.65 | 508.26 |
| 3 | 300378 | 康捷软件 | 191,570,104.58 | 422.61 |
| 4 | 002405 | 国海证券 | 183,913,227.70 | 406.72 |
| 5 | 300104 | 乐视网 | 176,685,616.77 | 389.08 |
| 6 | 300359 | 金通威 | 167,648,179.57 | 369.84 |
| 7 | 300259 | 康普药业 | 165,565,720.91 | 363.81 |
| 8 | 002071 | 长城影视 | 160,346,546.24 | 352.19 |
| 9 | 002242 | 华孚色纺 | 159,627,521.29 | 349.25 |
| 10 | 002123 | 荣信股份 | 156,109,421.42 | 342.18 |
| 11 | 002657 | 中科金财 | 151,114,648.14 | 333.37 |
| 12 | 300018 | 中元光电 | 141,001,476.61 | 311.06 |
| 13 | 002084 | 鼎腾卫浴 | 136,709,114.22 | 301.59 |
| 14 | 600270 | 恒生电子 | 136,834,971.90 | 299.69 |
| 15 | 002235 | 安联股份 | 133,644,042.04 | 294.82 |
| 16 | 002517 | 恒英药业 | 130,264,619.74 | 287.27 |
| 17 | 300380 | 安联药业 | 126,057,154.18 | 278.69 |
| 18 | 002651 | 尚荣医疗 | 123,483,564.17 | 272.41 |
| 19 | 300281 | 华录百纳 | 119,817,285.36 | 262.13 |
| 20 | 300336 | 新文化 | 113,726,941.99 | 250.01 |
| 21 | 300291 | 华录百纳 | 111,428,063.05 | 246.82 |
| 22 | 002188 | 巴士在线 | 109,747,637.37 | 242.11 |
| 23 | 002707 | 众信旅游 | 101,900,265.51 | 224.80 |
| 24 | 300031 | 恒信移动 | 101,579,480.87 | 224.09 |
| 25 | 600180 | 瑞茂通 | 100,534,862.29 | 221.79 |
| 26 | 300103 | 达瑞智能 | 100,211,531.98 | 221.07 |
| 27 | 300351 | 永贵电器 | 96,627,042.74 | 213.36 |

| | | | | | | | | | |
|----|--------|------|---------------|--------|-----|--------|------|--------------|------|
| 28 | 300282 | 新开普 | 90,130,531.07 | 198.25 | 222 | 000523 | 广州浪奇 | 1,738,932.12 | 3.94 |
| 29 | 300043 | 互动娱乐 | 86,692,956.60 | 191.25 | 223 | 600376 | 普开股份 | 1,664,109.00 | 3.32 |
| 30 | 002170 | 世纪股份 | 85,387,691.02 | 188.37 | 224 | 000807 | 云信股份 | 1,471,990.92 | 3.12 |
| 31 | 300056 | 天喻信息 | 85,284,426.65 | 188.14 | 225 | 600396 | 诚臣股份 | 1,413,799.92 | 3.25 |
| 32 | 300033 | 同花顺 | 85,022,505.54 | 187.56 | 226 | 600031 | 三一重工 | 1,377,450.00 | 3.26 |
| 33 | 002113 | 天润科技 | 83,034,096.08 | 183.18 | 227 | 001236 | 新华锦 | 1,319,400.00 | 2.91 |
| 34 | 600446 | 金证股份 | 81,419,385.20 | 179.61 | 228 | 300156 | 安居宝 | 1,316,420.00 | 2.90 |
| 35 | 300049 | 福耀股份 | 77,040,890.00 | 169.06 | 229 | 300220 | 金坛藏光 | 1,313,063.00 | 2.90 |
| 36 | 600730 | 中国高科 | 74,637,521.47 | 164.65 | 230 | 300130 | 新国都 | 1,273,000.00 | 2.81 |
| 37 | 600894 | 蓝盾股份 | 73,184,060.00 | 162.85 | 231 | 000218 | 证通电子 | 1,269,300.00 | 2.78 |
| 38 | 600418 | 江淮汽车 | 72,716,760.99 | 160.42 | 232 | 300397 | 蓝色光标 | 1,214,288.00 | 2.63 |
| 39 | 300227 | 光韵达 | 71,587,276.45 | 157.92 | 233 | 600056 | 武林股份 | 1,199,000.00 | 2.60 |
| 40 | 300399 | 英夫利 | 68,973,851.13 | 152.16 | 234 | 000056 | 永一科技 | 1,166,750.00 | 2.57 |
| 41 | 300339 | 尚林股份 | 68,893,128.02 | 151.98 | 235 | 000702 | 益盛股份 | 1,152,410.05 | 2.54 |
| 42 | 002942 | 碧松股份 | 67,653,481.13 | 149.25 | 236 | 000776 | 广发证券 | 1,137,435.00 | 2.51 |
| 43 | 002266 | 彩虹精化 | 67,551,664.40 | 149.02 | 237 | 600713 | 南京医药 | 1,013,666.00 | 2.24 |