（上接B112版）

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	150,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	150,000,000.00	-
项目	上年度末 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	99,975,269.96	-
合计	99,975,269.96	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均无从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	32,830.61	41,943.12
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	8,995.03	2,265.78
应收债券利息	1,148,403.31	1,980,966.20
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-24,118.14	29,871.68
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	358.71	227.81
合计	1,166,469.52	2,055,274.59

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,127,931.87	2,161,476.23
银行间市场应付交易费用	346.48	946.48
合计	1,128,278.35	2,162,422.71

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,244.88	6,319.47
预提审计费用	40,000.00	50,000.00
预提信息披露费	100,000.00	100,000.00
合计	141,244.88	156,319.47

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	336,404,623.55	336,404,623.55
本期申购	143,554,008.06	143,554,008.06
本期赎回（以"-"号填列）	-211,076,707.16	-211,076,707.16
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以"-"号填列）	-	-
本期末	268,881,924.45	268,881,924.45

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	251,843,345.60	164,559,880.14	416,403,225.74
本期利润	-84,338,939.03	-26,014,460.75	-110,353,399.78
本期基金份额交易产生的变动数	-34,364,015.53	-27,752,645.86	-62,116,661.39
其中：基金申购款	102,241,018.49	72,964,181.33	175,205,199.82
基金赎回款	-136,605,034.02	-100,716,827.19	-237,321,861.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,140,391.04	110,792,773.53	243,933,164.57

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	895,273.55	1,545,223.50
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	220,347.12	96,850.65
其他	11,381.88	7,839.23
合计	1,127,002.55	1,649,913.38

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出股票成交总额	4,139,415,276.70	4,084,878,123.91
减：卖出股票成本总额	4,209,580,704.41	3,987,605,771.77
买卖股票差价收入	-70,165,427.71	97,272,352.14

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,166,271.33	-1,597,117.32
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,166,271.33	-1,597,117.32

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,994,235.62	37,763,722.50
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,500,987.33	39,156,519.82
减：应收利息总额	659,519.62	204,320.00
买卖债券差价收入	-1,166,271.33	-1,597,117.32

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,456,665.66	3,226,223.58
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,456,665.66	3,226,223.58

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1.交易性金融资产	-26,014,460.75	21,024,715.83
——股票投资	-27,275,615.68	20,944,084.71
——债券投资	1,261,154.93	80,631.12
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-26,014,460.75	21,024,715.83

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	425,524.39	1,287,468.64
基金转换费收入	45,532.48	65,667.63
合计	471,056.87	1,353,136.27

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	11,289,236.40	11,247,827.12
银行间市场交易费用	10.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	11,289,246.40	11,247,827.12

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
其他费用	1,200.00	1,000.00
债券帐户维护费	36,000.00	31,500.00
银行费用	24,657.73	21,199.75
合计	201,857.73	203,699.75

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
民生加银基金管理有限公司(以下简称"民生加银基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司(以下简称"中国民生银行")	基金管理人的中方投资者、基金销售机构
加拿大皇家银行	基金管理人的外方投资者
三峡财务有限责任公司	基金管理人的中方投资者
民生加银资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.9.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方的交易单元进行的权证交易。

7.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

注：基金本报告期末及上年度末无应支付关联方的佣金。

7.4.9.2 关联方报酬

7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,413,743.27	12,763,548.05
其中：支付销售机构的客户维护费	1,202,825.96	1,526,405.70

注：支付基金管理人民生加银基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,735,623.94	2,127,258.05

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数

7.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金合同生效日（2013年6月7日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	5,697,435.90	5,697,435.90
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	5,697,435.90	5,697,435.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.1189%	1.6936%

7.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

7.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	131,472,206.29	895,273.55	43,752,948.83	1,545,223.50

注：本基金通过"中国建设银行"基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2018年12月31日的相关余额为人民币18,171,787.31元。(2017年12月31日：人民币4,577,475.19元）

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
601138	工业富联	2018年5月28日	2019年6月10日	老股转让锁定	13.77	10.97	17,576	242,021.52	192,808.72	-

注：根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于2018年12月31日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

于2018年12月31日，本基金未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

于2018年12月31日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值： 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值： 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于2018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划分为第一层次的余额为人民币181,267,128.93元(2017年12月31日：人民币468,795,518.08元），划分为第二层次的余额为人民币32,239,260.42元（2017年12月31日：人民币106,006,887.40元)无划分为第三层次余额（2017年12月31日：无）。

(a)第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2017年12月31日：无）。

7.4.14.2其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§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	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	180,694,932.45	34.39
	其中：股票	180,694,932.45	34.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,811,456.90	6.24
	其中：债券	32,811,456.90	6.24
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	150,000,000.00	28.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	149,643,993.60	28.48
8	其他各项资产	12,322,872.29	2.35
9	合计	525,473,255.24	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	55,476,848.22	10.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,535,938.43	20.38
J	金融业	50,145.80	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	12,040,000.00	2.35
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	8,592,000.00	1.68
S	综合	-	-
	合计	180,694,932.45	35.24

8.2.2

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	占基金资产净值比例（%）
1	300451	创业慧康	1,000,000	19,150,000.00	3.73
2	002436	兴森科技	3,800,000	17,176,000.00	3.35
3	600845	宝信软件	800,098	16,682,043.30	3.25
4	002916	深南电路	200,000	16,034,000.00	3.13
5	300017	网宿科技	2,000,000	15,660,000.00	3.05
6	300253	卫宁健康	1,200,000	14,952,000.00	2.92
7	601888	中国国旅	200,000	12,040,000.00	2.35
8	300750	宁德时代	160,000	11,808,000.00	2.30
9	002912	中新赛克	135,000	10,943,100.00	2.13
10	002594	比亚迪	200,000	10,200,000.00	1.99

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

8.4 报告期内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	603019	中科曙光	155,528,072.42	20.66
2	002415	海康威视	111,635,792.58	14.83
3	300017	网宿科技	97,257,608.10	12.92
4	603986	兆易创新	96,064,468.65	12.76
5	300454	深信服	89,786,682.52	11.93
6	601111	中国国航	81,239,366.73	10.79
7	603799	华友钴业	80,665,292.26	10.72
8	300383	光环新网	78,066,069.63	10.37
9	601138	工业富联	75,318,666.50	10.01
10	601888	中国国旅	71,710,913.37	9.53
11	002456	欧菲科技	71,030,879.32	9.44
12	002912	中新赛克	68,820,236.22	9.14
13	600009	上海机场	64,015,847.76	8.50
14	601601	中国太保	63,922,334.36	8.49
15	002027	分众传媒	63,310,897.24	8.41
16	002065	东华软件	58,128,920.02	7.72
17	300413	芒果超媒	54,720,030.16	7.27
18	300253	卫宁健康	53,224,971.97	7.07
19	000963	华东医药	53,025,714.89	7.04
20	601398	工商银行	51,770,100.60	6.88
21	603288	海天味业	49,719,432.20	6.60
22	002008	大族激光	47,254,859.96	6.28
23	000725	京东方A	47,028,590.00	6.25
24	600276	恒瑞医药	45,505,012.57	6.04
25	600519	贵州茅台	41,649,893.52	5.53
26	002460	赣锋锂业	41,509,119.91	5.51
27	600845	宝信软件	41,457,159.35	5.51
28	002273	水晶光电	39,836,383.71	5.29
29	300036	超图软件	39,793,285.27	5.29
30	300451	创业慧康	38,914,308.57	5.17
31	300010	立思辰	36,860,358.63	4.90
32	002916	深南电路	36,646,942.20	4.87
33	002179	中航光电	36,253,380.55	4.82
34	300015	爱尔眼科	35,975,600.59	4.78
35	300027	华谊兄弟	35,524,796.39	4.72
36	300073	当升科技	35,286,037.25	4.69
37	300750	宁德时代	34,319,950.54	4.56
38	600029	南方航空	34,016,767.70	4.52
39	002352	顺丰控股	33,538,837.49	4.46
40	002153	石基信息	32,845,455.18	4.36
41	000860	顺鑫农业	30,271,288.56	4.02
42	600872	中炬高新	29,987,835.39	3.98
43	600887	伊利股份	28,426,222.56	3.78
44	300348	长亮科技	27,592,158.86	3.67
45	601360	三六零	27,415,262.02	3.64
46	300339	润和软件	27,380,409.31	3.64
47	600588	用友网络	27,015,937.23	3.59
48	002146	荣盛发展	26,651,458.83	3.54
49	000938	紫光股份	26,336,300.67	3.50
50	601318	中国平安	26,097,987.00	3.47
51	600048	保利地产	25,869,978.00	3.44
52	300340	科恒股份	25,755,279.81	3.42
53	600967	内蒙一机	25,061,579.96	3.33
54	601288	农业银行	24,696,000.00	3.28
55	002126	银轮股份	24,384,171.10	3.24
56	600566	济川药业	24,006,114.18	3.19
57	300251	光线传媒	23,701,203.92	3.15
58	002044	美年健康	22,772,112.21	3.02
59	600036	招商银行	21,637,493.63	2.87
60	002439	启明星辰	21,431,119.74	2.85
61	300037	新宙邦	21,175,112.27	2.81
62	300059	东方财富	20,628,208.20	2.74
63	002600	领益智造	20,341,783.30	2.70
64	300188	美亚柏科	20,270,334.25	2.69
65	603043	广州酒家	18,786,099.17	2.50
66	603659	璞泰来	18,622,184.92	2.47
67	000333	美的集团	18,598,484.00	2.47
68	600258	首旅酒店	18,428,385.25	2.45
69	603589	口子窖	18,286,862.00	2.43
70	601336	新华保险	18,116,562.40	2.41
71	603056	德邦股份	18,004,282.55	2.39
72	600233	圆通速递	17,534,405.32	2.33
73	300450	先导智能	17,511,934.06	2.33
74	601988	中国银行	17,151,000.00	2.28
75	603103	横店影视	16,952,142.52	2.25
76	002466	天齐锂业	16,939,239.61	2.25
77	002436	兴森科技	16,629,001.00	2.21
78	002463	沪电股份	16,345,088.44	2.17
79	000066	中国长城	16,200,162.00	2.15
80	600315	上海家化	16,047,532.04	2.13
81	002387	维信诺	15,914,997.00	2.11
82	002050	三花智控	15,416,552.22	2.05
83	000858	五粮液	15,199,057.40	2.02

注："本期累计买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	603019	中科曙光	163,780,764.44	21.76
2	603986	兆易创新	130,664,769.76	17.36
3	300017	网宿科技	105,588,928.31	14.03
4	603799	华友钴业	102,457,103.29	13.61
5	002415	海康威视	99,745,454.37	13.25
6	002027	分众传媒	94,234,186.21	12.52
7	300383	光环新网	88,450,981.63	11.75
8	002456	欧菲科技	86,024,995.69	11.43
9	600009	上海机场	81,086,511.05	10.77
10	300454	深信服	80,743,644.18	10.73
11	601111	中国国航	77,659,191.45	10.32
12	601398	工商银行	71,711,648.60	9.53
13	601138	工业富联	68,989,041.94	9.16
14	002008	大族激光	67,396,501.52	8.95
15	002460	赣锋锂业	62,070,727.73	8.25
16	600519	贵州茅台	61,085,632.89	8.11
17	601601	中国太保	60,157,346.33	7.99
18	601888	中国国旅	56,835,791.65	7.55
19	002912	中新赛克	54,738,285.08	7.27
20	600566	济川药业	53,777,258.08	7.14
21	000963	华东医药	51,711,579.28	6.87
22	300413	芒果超媒	49,913,870.89	6.63
23	002065	东华软件	47,730,825.07	6.34
24	000725	京东方A	47,443,428.00	6.30
25	603288	海天味业	47,110,259.17	6.26
26	600276	恒瑞医药	45,633,562.37	6.06
27	002179	中航光电	45,275,679.24	6.01
28	300036	超图软件	41,199,995.66	5.47
29	002273	水晶光电	39,399,686.14	5.23
30	300253	卫宁健康	36,404,331.15	4.84
31	300010	立思辰	35,496,230.14	4.72
32	300015	爱尔眼科	35,417,525.10	4.70
33	300027	华谊兄弟	34,126,342.01	4.53
34	300073	当升科技	33,889,015.58	4.50
35	601988	中国银行	33,847,997.00	4.50
36	000858	五粮液	33,587,276.24	4.46
37	600029	南方航空	33,358,957.00	4.43
38	600138	中青旅	33,205,986.90	4.41
39	300433	蓝思科技	32,685,435.20	4.34
40	002635	安洁科技	31,640,416.48	4.20
41	600872	中炬高新	31,228,644.00	4.15
42	002352	顺丰控股	31,141,851.50	4.14
43	300059	东方财富	31,043,049.04	4.12
44	002153	石基信息	30,912,383.31	4.11
45	002555	三七互娱	29,589,596.92	3.93
46	000002	万科A	29,255,274.97	3.89
47	600487	亨通光电	28,142,660.15	3.74
48	300750	宁德时代	27,988,209.68	3.72
49	000938	紫光股份	27,558,174.46	3.66
50	002292	奥飞娱乐	27,072,067.32	3.60
51	300348	长亮科技	27,012,803.00	3.59
52	600588	用友网络	26,655,440.30	3.54
53	600048	保利地产	26,425,509.90	3.51
54	601318	中国平安	26,222,753.46	3.48
55	000860	顺鑫农业	26,062,436.16	3.46
56	300340	科恒股份	25,806,022.20	3.43
57	601360	三六零	25,220,706.56	3.35
58	300339	润和软件	25,165,159.06	3.34
59	600845	宝信软件	24,782,361.60	3.29
60	600887	伊利股份	24,761,149.04	3.29
61	002146	荣盛发展	24,700,672.17	3.28
62	600967	内蒙一机	24,387,127.40	3.24
63	601288	农业银行	24,302,135.00	3.23
64	300251	光线传媒	23,662,351.71	3.14
65	002916	深南电路	23,564,690.73	3.13
66	002044	美年健康	22,870,792.00	3.04
67	300037	新宙邦	22,782,200.27	3.03
68	300451	创业慧康	22,318,887.00	2.96
69	002126	银轮股份	21,967,335.50	2.92
70	600036	招商银行	21,711,681.00	2.88
71	002439	启明星辰	20,203,135.52	2.68
72	002600	领益智造	20,123,918.55	2.67
73	002463	沪电股份	19,124,761.20	2.54
74	000333	美的集团	18,221,324.92	2.42
75	603659	璞泰来	18,144,612.44	2.41
76	002466	天齐锂业	18,066,900.00	2.40
77	601336	新华保险	17,728,688.94	2.36
78	300188	美亚柏科	17,709,255.14	2.35
79	600522	中天科技	17,669,989.94	2.35
80	603056	德邦股份	17,522,078.85	2.33
81	002405	四维图新	17,276,610.33	2.29
82	600258	首旅酒店	17,246,159.71	2.29
83	603589	口子窖	17,107,491.00	2.27
84	000066	中国长城	16,918,217.15	2.25
85	600570	恒生电子	16,723,581.71	2.22
86	603043	广州酒家	16,521,118.96	2.19
87	603103	横店影视	16,458,632.72	2.19
88	600233	圆通速递	16,329,840.23	2.17
89	002387	维信诺	16,028,665.00	2.13
90	600315	上海家化	15,818,468.07	2.10
91	002050	三花智控	15,694,893.00	2.08
92	600446	金证股份	15,669,324.87	2.08

注："本期累计卖出金额"按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。8.4.1 8.4.2 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,890,800,136.36
卖出股票收入（成交）总额	4,139,415,276.70

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	15,988,305.90	3.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,008,000.00	3.12
	其中：政策性金融债	16,008,000.00	3.12
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	815,151.00	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,811,456.90	6.40

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018002	国开1302	160,000	16,008,000.00	3.12
2	019519	15国债19	90,010	9,054,105.90	1.77
3	019535	16国债07	70,000	6,934,200.00	1.35
4	128020	水晶转债	8,900	815,151.00	0.16

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有