国投瑞银核心企业混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人：国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一九年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	国投瑞银核心企业混合
基金主代码	121003
交易代码	121003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月19日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
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	1,551,379,467.34份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是“追求基金资产长期稳定增值”。
投资策略	本基金将借鉴UBS AM投资管理经验，根据中国市场的特点，采取积极的投资管理策略。 （一）投资管理方法 本基金将借鉴UBS AM投资管理流程和方法，并加以本土化，我们所借鉴的投资管理工具主要包括GEVS等股票供值方法和GERS股票风险管理方法等。 （二）战略资产配置 本基金战略资产配置遵循以下原则： (1)股票的合投资比例：60-95%。 (2)债券组合投资比例：0-40%。 (3)现金和货币（1年期以内）的政府债券不低于5%。 （三）投资投资管理 国投瑞银的投资决策，以自下而上的公司基本面分析为主，自上而下的研究为辅。两者在投资决策中是互动的，国家和行业配置原则自下而上的公司基本面分析，而公司分析的基本面基本作又基于自上而下的宏观研究结果。 （四）债券投资管理 本基金借鉴UBS AM固定收益组合的管理方法，采取“自上而下”的债券分析方法，确定债券模拟组合，并管理组合风险。
业绩比较基准	95%×金融同业存款利率+95%×标普中国A股300指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，股票最低投资比例为60%，属于按照风险收益较高的基金品种，其按照风险和预期收益高于债券型基金、低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凯	郭明
	联系电话	400-880-6868	010-66105798
	电子邮箱	service@ubsdic.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-880-6868	95588
传真		0755-82904048	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.ubsdic.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-172,601,360.34	-17,584,374.60	-422,217,478.53
本期利润	-175,972,724.77	44,745,304.55	-576,507,061.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1127	0.0259	-0.3332
本期基金份额净值增长率	-16.04%	3.21%	-32.15%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.4150	-0.3032	-0.3249
期末基金资产净值	907,499,445.63	1,100,179,127.65	1,148,248,936.05
期末基金份额净值	0.5850	0.6968	0.6751

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

2.对期末可供分配利润，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.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

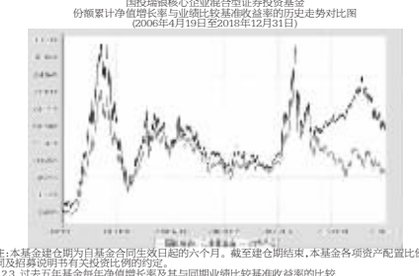
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.51%	1.39%	-12.13%	1.53%	0.62%	-0.14%
过去六个月	-10.41%	1.37%	-13.19%	1.41%	2.78%	-0.04%
过去一年	-16.04%	1.78%	-24.09%	1.26%	8.05%	0.52%
过去三年	-41.20%	1.76%	-15.03%	1.09%	-26.17%	0.67%
过去五年	-10.26%	1.84%	31.65%	1.42%	-41.91%	0.42%
自基金合同生效起至今	84.71%	1.68%	180.68%	1.67%	-95.97%	0.01%

注：1.本基金业绩比较基准为5%×金融同业存款利率+95%×标普中国A股300指数收益率，其中：同业存款利率是中国人民银行规定的金融机构间存款利率；标普中国A股300指数是标准普尔（Standard & Poor's）开发的中国A 股市场指数，由深沪股市具有行业代表性的上市公司组成，其样本股票经过了流动性和财务稳健性的审慎检查，能较全面地描述A 股市场的总体趋势。

2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

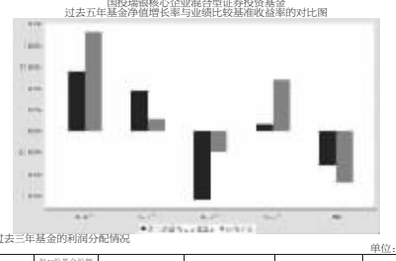
国投瑞银核心企业混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2006年4月19日至2018年12月31日）



注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至建仓期结束，本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国投瑞银核心企业混合型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	1.150	79,842,692.44	104,733,217.91	184,575,910.35	-
合计	1.150	79,842,692.44	104,733,217.91	184,575,910.35	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

国投瑞银基金管理有限公司（简称“公司”），原中融基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会批准，于2005年6月13日正式成立，注册资本1亿元人民币。公司是中国第一家外方持股比例达到49%的合资基金管理公司，公司股东为国投瑞银控股有限公司（国家开发投资公司的控股子公司）及瑞士银行股份有限公司（UBS AG）。公司拥有完善的法人治理结构、健全了有效的风险管理及控制架构，以“诚信、创新、包容、客户关注”作为公司的企业文化。截止2018年12月底，在公募基金方面，公司共管理70只基金，已建立起覆盖高、中、低风险等级的完整产品线；在专户理财业务方面，自2006年获得特定客户资产管理业务资格以来，已成功运作管理的专户产品涵盖了灵活配置型、稳健增利型等常规产品，还包括分级、期指套利、盾品期货、QDII等创新品种；在境外资产管理业务方面，公司自2006年开始为QFII信托计划提供投资咨询服务，具有丰富经验，并于2007年获得QDII资格。

4.1.2基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
于雷	本基金基金经理	2015-11-21	-	11	中国籍，博士，具有基金从业资格，特许金融分析师（CFA），曾任职于华夏基金、长城基金、景顺长城基金及融通基金投资基金、长城久利保基混合型证券投资基金、长城久兴保基混合型证券投资基金及长城中小盘成长股票型证券投资基金基金经理。2015年7月加入国投瑞银基金，现任国投瑞银核心企业混合型证券投资基金及国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
古莉	本基金基金经理	2018-07-31	-	11	中国籍，硕士，具有基金从业资格，曾任国投瑞银基金管理有限公司研究员，中信证券股份有限公司研究员，自2017年4月加入国投瑞银基金管理有限公司，现任国投瑞银新回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国投瑞银瑞利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国投瑞银瑞丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国投瑞银瑞祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国投瑞银核心企业混合型证券投资基金基金经理。

注：任职日期和离任日期为指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其系列法规和《国投瑞银核心企业混合型证券投资基金基金合同》等有关规定，本着恪守诚信、审慎勤勉，追求投资者的合法利益的原则管理和运用基金资产。在报告期内，基金的投资决策流程，基金运作合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

管理人依据证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，制定了公平交易管理相关的《公平交易管理规定》、《交易管理办法》、《异常交易管理规定》等系列制度，并建立和完善了相应的控制措施和业务流程。

管理人公平交易管理坚持以下原则：

1.当管理人对基金持有人利益发生冲突时，坚持基金持有人利益优先；

2.当不同资产委托人利益发生冲突时，应公平的对待不同的资产委托人；

3.公平对待管理人旗下管理的不同投资组合；

4.严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

管理人有关公平交易控制制度的要点如下：

1.不断完善投资决策、研究支持、交易管理的制度和流程，提高投资管理的科学性和客观性，确保在公司内建立适用于所有投资组合的公平交易环境。

2.公平对待所投资的非投资标的，以及一级市场申购、二级市场交易和公司内部证券分配等所有投资管理活动，同时随着研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

3.合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资决策和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.建立科学的投资决策体系，加强交易执行与研究流程、组合构建流程、技术手段等保证公平交易原则的实现，同时通过监察稽核、事后分析及信息披露来加强对公平交易的监督。

管理人有关公平交易控制方法的要点如下：

1.以系统强制控制为优先措施。公司通过不断完善投资决策、研究支持、交易执行相关的信息管理系统，充分发挥系统的自动控制功能，根据公平交易管理规定的要求，在系统中设置相应业务流转顺序，控制每位或者每个投资组合被触发指令前必须经过的投资决策流程的执行与指令发出前必须经过的交易执行前的公平交易检查流程。如：符合交易条件的不同投资组合的同向交易指令在交易系统中强制采用公平委托功能进行交易，内部研究报告在研究系统中一经发布会自动推送到所有基金经理、投资经理，控制权限的修改必须经监察稽核部通过系统进行复核并立即同意才能生效等。

2.以双人复核、集体决策为控制的辅助手段。对于无法通过系统进行强制控制的业务活动，通过建立明确的业务规则和流程，在关键控制点采取双人复核或集体决策等控制机制，通过分别对控制事项签署意见并顺序流转的要求，实现对关键业务风险的管理。如：以公司名义进行的一级市场申购结果分配，需要经过严格的公平性审核，由交易部负责人、监察稽核部负责人以及投资组合经理共同确认对分配结果无异议并签署后方可执行。

3.以日常监控为督促手段，公司交易部、监察稽核部、运营部设置专门岗位，分别在交易过程中、日中、请算后对有关公平交易规则的执行情况进行监控，并按既定的报告要求及时揭示违反规定的行为，监督督促公平交易制度的执行。如：交易部对相同投资经理管理不同投资组合指令时间差的监督，监察稽核部对日中不同组合交易相同证券的价差分析以及运营部对银行间指令要素不符情况的检查等。

4.以事后专项稽核和定期公平交易分析为完善措施。内部审计专员负责不定期对公司执行公平交易的情况进行专项稽核，监察稽核部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，通过事后的专项稽核和定期分析，及时发现可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

5.加强信息披露和接受外部监督。公司存在投资组合的定期投告中，披露公司整体公平交易制度执行情况以及异常交易行为专项说明，接受社会监督。公司定期接受外部审计的检查，公平交易管理一直是外部审计的重点之一。基金评价机构在开展基金评价业务时，将公平交易制度的完善程度、执行情况及信息披露作为评价内容之一。公司每季度会同证监会报告经投资组合经理、督察长、总经理签署后的公平交易制度执行情况，并对特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明，公司内部稽核或定期分析中发现公平交易管理中的异常问题，也将在证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中做专项说明。证监会通过现场检查和非现场监管等方式，也会对公司公平交易制度的执行情况进行检查和分析，并会同证券交易所等对公司异常交易行为进行监控。对于发现的不公平交易和利益输送行为，将依法采取相关监管措施。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现，确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露实现对公平交易过程和结果的监督，形成了有效地公平交易体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

报告期内，管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本年度同向交易价差专项分析的情况如下：

1、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差的溢价率进行分析，对两两组合间同交易成交价格均值的溢价率是否超过于零进行T检验，检验在95%的可信水平下，价格均值的溢价率检验不显著存在检验不通过的情况。

2、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差优劣进行比较，区分买优、卖优、买次、卖次等情况分别分析两两组合在期间内交易时是否存在显著优于另一方的异常情况。

3、管理人对所有投资组合在过去连续四个季度内同向交易相同证券的交易价差区分两两组合进行利益输送的模拟测算，检查在过去四个季度内，是否存在显著异常的情况。

检验分析结果显示，公司管理的所有投资组合，在过去连续四个季度内未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

基金管理人管理的所有投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易超过该证券当日成交量5%的交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018年投资操作，本基金超越基准获得超额收益主要来源于阶段性超配行业获得了较明显超额收益。上半年，本基金主要配置了云计算、半导体、生物医药、军工、新能源汽车等科技板块跑赢制造行业，三季度本基金减持科技股，大幅增加了金融和消费白马股。2018年亏损主要来源于四季度，市场在内部经济数据不佳和预期外黑天鹅加剧的双重打击下，市场出现了大幅调跌。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.5850元，本报告期份额净值增长率为-16.04%，同期业绩比较基准收益率为-24.09%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年，中美经济都存在向下压力，贸易摩擦的复杂和反复更是给全球经济增加了不确定性。伴随经济增长的压力显现，国内稳定经济的政策将逐步出台，同时，本轮下行周期中，很多行业的优秀企业库存控制良好，供求格局好于上一轮周期调整。目前A股股权风险溢价已处于历史极值附近，同时，中国经济的全球比较优势和中国资本市场的开放政策将促使国际资金进一步加大配置，A股有全球竞争力的行业和公司将是进入越跌越有价值的区域。不论是监管口马，还是成长行业的优质龙头，很多优质公司估值已经具备长期投资价值。而很多原先被定价的防成长股，仍将在强势经济中继续承受生产力和资本生存。

2019年，本基金主要策略是，优选景气行业好公司或具备中期价值的公司。行业配置相对均衡，主要包括金融消费领域里的优质公司，同时精选成长行业中的优质龙头，比如：新能源车、创新药企和服务商、军工、高铁特高压等。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序遵常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算岗与产品托管人的估值结果核对一致。

本基金估值时的估值程序由估值委员会按照国际惯例和行业惯例、结算备付金、其他应收款项类投资以及其他金融负债预剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的持续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639,796,257.31元，划分为第二层次的余额为102,694,672.99元，无划分为第三层次余额（于2017年12月31日，本基金持有的持续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975,529,581.62元，划分为第二层次的余额为43,864,508.20元，无划分为第三层次余额）

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或因售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§5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	662,449,930.30	71.02
	其中：股票	662,449,930.30	71.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,041,000.00	8.58
	其中：债券	80,041,000.00	8.58
	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	100,000,000.00	10.72
	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	87,169,807.40	9.35
8	其他各项资产	3,053,919.69	0.33
9	合计	932,714,657.39	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

8.2 报告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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11,537,526.00	1.27
B	采矿业	13,068,025.20	1.44
C	制造业	263,595,311.25	29.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,989,118.68	1.98
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,592,963.60	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	63,838,437.52	7.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,462,444.19	6.33
J	金融业	98,146,156.68	10.82
K	房地产业	20,052,938.46	2.21
L	租赁和商务服务业	11,512,763.50	1.27
M	科学研究和技术服务业	20,478,926.18	2.26
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	58,175,386.24	6.41
S	综合	-	-
	合计	662,449,930.30	73.00

8.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	占基金资产净值比例(%)
1	601933	永辉超市	3,124,900.00	24,592,963.00	2.71
2	601288	农业银行	6,661,122.00	23,980,039.20	2.64
3	600887	伊利股份	964,915.00	22,079,030.84	2.43
4	600406	国电南瑞	1,185,024.00	21,958,494.72	2.42
5	000333	美的集团	595,102.00	21,935,459.72	2.42
6	002821	凯莱英	314,314.00	21,326,204.90	2.35
7	601211	国泰君安	1,375,600.00	21,074,192.00	2.32
8	002368	太极股份	896,942.00	20,809,054.40	2.29
9	603259	药明康德	273,563.00	20,478,926.18	2.26
10	000002	万 科A	841,853.00	20,052,938.46	2.21

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	603799	华友钴业	202,074,735.08	18.37
2	600030	中信证券	185,768,260.33	16.89
3	601211	国泰君安	160,313,991.18	14.57
4	000933	神火股份	145,261,110.80	13.20
5	300618	寒锐钴业	136,031,063.60	12.36
6	600967	内蒙一机	126,727,474.13	11.52
7	600588	用友网络	120,736,951.32	10.97
8	000768	中航飞机	118,532,593.96	10.77
9	600760	中航沈飞	117,734,238.44	10.70
10	002368	太极股份	115,898,082.56	10.53
11	000001	平安银行	109,590,411.49	9.96
12	001979	招商蛇口	109,346,194.80	9.94
13	600036	招商银行	108,372,751.94	9.85
14	600884	杉杉股份	106,806,603.57	9.71
15	600887	伊利股份	104,605,620.29	9.51
16	600519	贵州茅台	99,995,655.07	9.09
17	000002	万 科A	99,541,873.80	9.05
18	601318	中国平安	98,702,400.73	8.97
19	300166	东方国信	97,681,593.60	8.88
20	000977	浪潮信息	97,513,479.13	8.86
21	600048	保利地产	95,443,104.62	8.68
22	603019	中科曙光	95,321,282.65	8.66
23	601688	华泰证券	94,351,313.15	8.58
24	300037	新宙邦	92,306,994.82	8.39
25	000538	云南白药	84,614,490.83	7.69
26	600019	宝钢股份	77,527,282.31	7.05
27	600085	同仁堂	76,189,761.03	6.93
28	600038	中直股份	76,167,978.45	6.92
29	603986	兆易创新	75,963,919.72	6.90
30	601857	中国石化	74,945,495.04	6.81
31	600271	航天信息	73,294,836.42	6.66
32	601601	中国太保	72,464,547.20	6.59
33	601288	农业银行	71,395,303.00	6.49
34	300568	星源材质	69,561,806.63	6.32
35	002371	北方华创	68,938,158.34	6.26
36	002110	三钢闽光	68,264,530.11	6.20
37	600570	恒生电子	67,386,951.33	6.13
38	601225	陕西煤业	64,997,685.39	5.91
39	600837	海通证券	64,538,245.09	5.87
40	300383	光环新网	64,233,037.68	5.84
41	601111	中国国航	64,116,841.32	5.83
42	300287	飞利信	63,518,588.85	5.77
43	600196	复星医药	62,751,268.87	5.70
44	600845	宝信软件	58,073,760.48	5.28
45	300122	智飞生物	57,553,621.37	5.23
46	000807	云铝股份	57,162,597.30	5.20
47	002475	立讯精密	57,049,863.58	5.19
48	002223	鱼跃医疗	55,387,313.90	5.03
49	300124	汇川技术	54,701,406.53	4.97
50	000651	格力电器	53,830,325.62	4.89
51	601600	中国铝业	52,890,487.77	4.81
52	600900	长江电力	52,338,187.11	4.76
53	002439	启明星辰	52,165,520.73	4.74
54	603259	药明康德	51,748,993.60	4.70
55	300027	华谊兄弟	49,117,071.02	4.46
56	601336	新华保险	49,040,701.22	4.46
57	002821	凯莱英	48,395,522.20	4.40
58	603103	横店影视	48,308,418.08	4.39
59	601933	永辉超市	47,870,627.47	4.35
60	601939	建设银行	47,428,934.57	4.31
61	300498	温氏股份	47,035,692.30	4.28
62	300017	网宿科技	46,807,585.48	4.25
63	600702	舍得酒业	46,435,834.50	4.22
64	600460	士兰微	46,264,319.00	4.21
65	000333	美的集团	46,134,871.50	4.19
66	300550	和仁科技	45,046,463.71	4.09
67	002376	新北洋	44,196,872.64	4.02
68	601818	光大银行	43,956,014.00	4.00
69	000066	中国长城	43,387,433.30	3.94
70	002737	葵花药业	43,044,110.79	3.91
71	600536	中国软件	42,393,825.41	3.85
72	601088	中国神华	41,827,670.79	3.80
73	600029	南方航空	41,115,736.13	3.74
74	002202	金风科技	40,881,453.18	3.72
75	600754	锦江股份	40,793,143.90	3.70
76	300409	道氏技术	40,278,147.38	3.66
77	002142	宁波银行	39,786,156.34	3.62
78	600176	中国巨石	39,213,215.69	3.56
79	300136	信维通信	39,174,607.49	3.56
80	600998	九州通	38,247,508.80	3.48
81	002714	牧原股份	37,692,761.12	3.43
82	300253	卫宁健康	36,418,030.85	3.31
83	002292	奥飞娱乐	36,361,699.80	3.31
84	300308	中际旭创	35,883,130.99	3.26
85	300036	超图软件	35,486,161.66	3.23
86	002456	欧菲科技	35,226,883.25	3.20
87	300601	康泰生物	35,156,275.33	3.20
88	600373	中文传媒	34,993,739.16	3.18
89	600872	中炬高新	34,891,174.35	3.17
90	000932	华菱钢铁	33,772,545.07	3.07
91	300170	汉得信息	33,595,363.85	3.05
92	600559	老白干酒	33,591,829.47	3.05
93	002415	海康威视	33,319,482.12	3.03
94	002153	石基信息	32,269,154.55	2.93
95	600372	中航电子	32,104,120.76	2.92
96	603993	洛阳钼业	32,017,399.00	2.91
97	300014	亿纬锂能	31,989,710.57	2.91
98	603368	柳药股份	31,471,624.90	2.86
99	603035	恒福股业	31,375,274.79	2.85
100	300431	暴风集团	31,370,730.99	2.85
101	300558	贝达药业	30,886,495.13	2.81
102	300113	顺网科技	30,861,994.06	2.81
103	002304	洋河股份	30,736,414.74	2.79
104	002624	完美世界	30,530,876.00	2.78
105	000681	视觉中国	30,354,443.60	2.76
106	300059	东方财富	29,849,908.87	2.71
107	002179	中航光电	29,328,720.89	2.67
108	002773	康弘药业	29,029,029.37	2.64
109	300271	华宇软件	28,991,224.76	2.64
110	002422	科伦药业	28,773,260.39	2.62
111	601877	正泰电器	28,420,170.85	2.58
112	000069	华侨城A	28,302,541.00	2.57
113	600581	八一钢铁	28,215,638.88	2.56
114	300033	同花顺	27,945,876.42	2.54
115	600282	南钢股份	27,877,258.75	2.53
116	000938	紫光股份	27,652,724.15	2.51
117	600893	航发动力	27,625,852.72	2.51
118	300604	长川科技	27,407,050.63	2.49
119	300251	光线传媒	27,271,606.00	2.48
120	000983	西山煤电	27,122,873.00	2.47
121	600236	桂冠电力	26,835,105.90	2.44
122	300377	赢时胜	26,492,588.12	2.41
123	600690	青岛海尔	26,460,421.19	2.41
124	601009	南京银行	25,958,372.25	2.36
125	600885	宏发股份	25,790,396.96	2.34
126	600068	葛洲坝	25,575,620.04	2.32
127	601898	中煤能源	25,445,766.00	2.31
128	601139	深圳燃气	25,108,827.12	2.28
129	600999	招商证券	24,936,291.03	2.27
130	601607	上海医药	24,562,488.46	2.23
131	000776	广发证券	24,419,235.99	2.22
132	600879	航天电子	23,797,338.50	2.16
133	002511	中顺洁柔	23,421,279.98	2.13
134	002128	露天煤业	23,132,687.15	2.10
135	600507	方大特钢	22,956,618.95	2.09
136	300426	唐德影视	22,803,634.67	2.07
137	300075	数字政通	22,470,351.00	2.04
138	300207	欣旺达	22,108,725.27	2.01

注：“买入金额”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。8.4.2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	603799	华友钴业	207,165,510.48	18.83
2	600030	中信证券	167,479,782.02	15.22
3	000933	神火股份	167,094,622.44	15.19
4	601211	国泰君安	141,692,296.05	12.88
5	600760	中航沈飞	138,592,620.42	12.60
6	600588	用友网络	136,210,721.13	12.38
7	002368	太极股份	133,631,703.82	12.15