

(上接B36版)

为交通银行股份有限公司。

原基金管理人于基金合同失效前经审计的基金资产净值为3,172,904,977.06元,已于本基金的基金合同生效之日起作为本基金的基金资产净值。根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《关于安顺基金基金份额拆分的公告》的有关规定,本基金于2014年6月9日进行了基金份额拆分,拆分为1:1.008546777,并于2014年6月10日进行了变更登记。

本基金自2014年5月16日至2014年6月4日期间内开成集中申购,共募集集中申购资金1,081,514,229.95元,其中包括符合本基金的基金资产净值的集中申购资金利息390,635.25元,业经普华永道中天会计师事务所特准特殊普通合伙普华永道中天验字(2014)第308号审计报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2014年6月9日基金份额折算后的基金份额净值1.0000元折合为1,081,514,229.95基金份额,其中包括集中申购资金利息折合的390,635.25份基金份额,并于2014年6月10日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的申购对象是具有良好投资价值的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票,含普通股和优先股)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票等权益类资产占基金资产的比例为0%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易所保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:50%×中证800指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2014年8月28日批准报出。

6.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定以“合并”“企业会计准则”,中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号—年度报告和半年度报告》、《中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《本财务报表附注所列示的中国证监会颁布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定声明

本基金2014年5月12日(基金合同生效日)至2014年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014年5月12日(基金合同生效日)至2014年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本报告财务报表的实际编制期间为2014年5月12日(基金合同生效日)至2014年6月30日。

6.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的种类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易为目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融负债外,其他负债均以公允价值列示。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价,回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前无其他金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次付息日至购买日的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产的控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

6.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具主要为权证投资,按照下列原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

6.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依(1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且(2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额列示在资产负债表内列示。

6.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总额在扣除损益准备金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.2.4.4.8 损益准备金

损益准备金包括已实现公允价值未实现的准备金。已实现准备金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现准备金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现的损益占基金净值比例计算的金额。损益准备金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(未计亏损)。

6.2.4.4.9 收入损失的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的票面利息或发行价计算的利息和折价在适当情况下摊发发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值变动损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额持有人产生的未实现准备金等为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润中的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润已实现部分相抵未实现部分后的余额。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的分配权益收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内部同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。本基金目前以下列一个的经营分部运作,不需要披露分部信息。

6.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1)对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法,或采用估值技术确定公允价值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会公告证监字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务和份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场交易债券按照现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中国国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

6.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的股息红利利息收入,由发行债券的企业在向基金派发股息红利时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。2013年1月1日前,对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在派发股息红利时,红利暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定扣缴20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4)基金买卖股票应缴纳的1%的税率缴纳股票交易印花税,卖出股票卖出金额缴纳交易印花税。

6.2.4.7 关联方关系

6.2.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.2.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的相关方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|----------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金”) | 基金管理人 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金托管人 |
| 上海国信信托有限公司 | 基金持有人的股东 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1 股票交易

无。

6.2.4.8.1.2 权证交易

无。

6.2.4.8.1.3 债券交易

无。

6.2.4.8.1.4 债券回购交易

无。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1 基金管理费

注:1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基础资产净值

2.基金管理费每日计算,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前2个工作日内从基金财产中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。

6.2.4.8.2.2 基金托管费

注:1.本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基础资产净值

2.基金托管费每日计算,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,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

6.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.2.4.8.4 关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1 报告期内关联方资金运用情况

6.2.4.8.4.2 报告期内除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

| 关联方名称 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
|------------|--------------|------------------|
| 上海国信信托有限公司 | 4,070,796.00 | 0.11% |

注:1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

2.本基金用于证券交易结算的资金通过“交通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,按约定利率计息。于2014年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

6.2.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

无。

6.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.2.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1 因认购发行/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌前收盘价(元) | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末公允价值 | 备注 | | | |
|--------|------|------------|-----------|-------|------------|--------|-----------|---------------|---------------|---|
| 002059 | 云南铜业 | 2014-06-23 | 重大资产重组停牌 | 8,95 | 2014-08-14 | 9.82 | 1,689,939 | 14,595,355.49 | 15,091,074.90 | - |

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易作为抵押的债券

无。

6.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7.1 安顺证券投资基金

7.1.1 期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产比例(%) |
|----|----------|------------------|-------------|
| 1 | 权益投资 | 2,500,843,338.85 | 76.32 |
| 2 | 固定收益 | 653,014,810.00 | 19.93 |
| 3 | 货币资金 | 653,014,810.00 | 19.93 |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 其他金融资产 | - | - |
| 6 | 其他负债 | - | - |
| 7 | 合计 | 3,253,858,148.85 | 100.00 |

7.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金总资产比例(%) |
|----|-----------------|------------------|-------------|
| 1 | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| 2 | 采矿业 | - | - |
| 3 | 制造业 | 1,680,091,650.75 | 43.71 |
| 4 | 电力、热力、燃气及生产供应业 | 242,239,766.62 | 6.02 |
| 5 | 建筑业 | 28,596,722.64 | 0.87 |
| 6 | 批发和零售业 | 96,100,000.00 | 2.55 |
| 7 | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| 8 | 住宿和餐饮业 | - | - |
| 9 | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 484,167,403.68 | 12.60 |
| 10 | 金融业 | 411,078,488.95 | 10.69 |
| 11 | 房地产业 | 334,917,660.97 | 8.71 |
| 12 | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 13 | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 14 | 水利、环境和公共设施管理业 | 152,506,824.80 | 3.97 |
| 15 | 建筑业 | - | - |
| 16 | 教育 | - | - |
| 17 | 卫生和社会工作 | - | - |
| 18 | 文化、体育和娱乐业 | 191,698,658.10 | 4.99 |
| 19 | 综合 | - | - |
| 20 | 合计 | 3,578,831,119.99 | 93.10 |

7.2 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

| 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 | 200022 | 招商局港口 | 19,999,000 | 34,842,200.00 | 8.19 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 6,680,000 | 270,619,200.00 | 7.04 |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 15,699,998 | 265,957,966.12 | 6.92 |
| 4 | 002241 | 歌尔声学 | 9,500,000 | 23,270,000.00 | 6.59 |
| 5 | 002450 | 康得新 | 10,099,918 | 229,773,134.50 | 5.98 |
| 6 | 602375 | 安源股份 | 9,999,919 | 225,598,127.64 | 5.97 |
| 7 | 600352 | 浙江龙盛 | 12,999,900 | 209,948,385.00 | 5.46 |
| 8 | 002001 | 中航光电 | 16,666,000 | 206,500,289.10 | 5.37 |
| 9 | 300133 | 华星光电 | 3,999,958 | 19,699,658.10 | 4.99 |
| 10 | 002285 | 世联行 | 23,238,497 | 186,140,360.97 | 4.84 |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.huann.com.cn网站的半年度报告正文。

7.2.1 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.1.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 278,715,839.56 | 7.25% |
| 2 | 002241 | 歌尔声学 | 192,404,182.55 | 5.01% |
| 3 | 002415 | 海康威视 | 116,909,654.57 | 3.04% |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 108,902,332.41 | 2.83% |
| 5 | 000002 | 万科A | 90,318,246.18 | 2.33% |
| 6 | 600770 | 恒立股份 | 90,266,015.21 | 2.25% |
| 7 | 002375 | 安源股份 | 85,568,047.21 | 2.23% |
| 8 | 002450 | 康得新 | 85,427,307.63 | 2.14% |
| 9 | 300070 | 雷沃重工 | 54,810,281.26 | 1.43% |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 52,534,400.02 | 1.37% |
| 11 | 600028 | 中国石化 | 50,769,534.78 | 1.32% |
| 12 | 600468 | 国药控股 | 47,494,662.43 | 1.24% |
| 13 | 002285 | 世联行 | 42,932,525.08 | 1.12% |
| 14 | 300133 | 华星光电 | 40,965,828.81 | 1.07% |
| 15 | 600352 | 浙江龙盛 | 38,543,574.01 | 1.00% |
| 16 | 600183 | 华泰科技 | 36,649,582.51 | 0.95% |
| 17 | 002001 | 中航光电 | 31,194,270.20 | 0.80% |
| 18 | 600196 | 复星医药 | 29,398,927.63 | 0.76% |
| 19 | 002456 | 欧陆电子 | 26,637,957.96 | 0.69% |
| 20 | 601965 | 中国国贸 | 26,604,637.72 | 0.69% |

注:本项“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。

7.2.1.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600088 | 保利地产 | 121,486,862.68 | 3.16% |
| 2 | 600389 | 华孚实业 | 104,413,800.97 | 2.72% |
| 3 | 002315 | 伟星股份 | 76,566,285.38 | 1.95% |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 52,133,720.49 | 1.36% |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 51,967,024.99 | 1.33% |
| 6 | 600006 | 国电南瑞 | 49,099,667.45 | 1.28% |
| 7 | 002241 | 歌尔声学 | 39,769,679.26 | 1.04% |
| 8 | 002410 | 广联达 | 36,605,240.76 | 0.93% |
| 9 | 002459 | 广明光电 | 33,666,186.75 | 0.88% |
| 10 | 002456 | 欧陆电子 | 30,475,028.13 | 0.79% |
| 11 | 600352 | 浙江龙盛 | 17,444,852.90 | 0.45% |
| 12 | 600153 | 盛通股份 | 17,025,017.03 | 0.43% |
| 13 | 300271 | 华星光电 | 13,590,411.06 | 0.35% |
| 14 | 002250 | 聚华科技 | 12,350,094.13 | 0.32% |
| 15 | 601965 | 中国国贸 | 8,473,709.43 | 0.22% |
| 16 | 002450 | 康得新 | 4,470,116.77 | 0.12% |
| 17 | 002001 | 中航光电 | 3,957,924.46 | 0.10% |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 3,957,924.46 | 0.10% |
| 19 | 300070 | 雷沃重工 | 2,962,929.56 | 0.08% |
| 20 | 002285 | 世联行 | 1,401,156.02 | 0.04% |

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.2.1.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600389 | 华孚实业 | 121,486,862.68 | 3.16% |
| 2 | 600389 | 华孚实业 | 104,413,800.97 | 2.72% |
| 3 | 002315 | 伟星股份 | 76,566,285.38 | 1.95% |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 52,133,720.49 | 1.36% |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 51,967,024.99 | 1.33% |
| 6 | 600006 | 国电南瑞 | 49,099,667.45 | 1.28% |
| 7 | 002241 | 歌尔声学 | 39,769,679.26 | 1.04% |
| 8 | 002410 | 广联达 | 36,605,240.76 | 0.93% |
| 9 | 002459 | 广明光电 | 33,666,186.75 | 0.88% |
| 10 | 002456 | 欧陆电子 | 30,475,028.13 | 0.79% |
| 11 | 600352 | 浙江龙盛 | 17,444,852.90 | 0.45% |
| 12 | 600153 | 盛通股份 | 17,025,017.03 | 0.43% |
| 13 | 300271 | 华星光电 | 13,590,411.06 | 0.35% |
| 14 | 002250 | 聚华科技 | 12,350,094.13 | 0.32% |
| 15 | 601965 | 中国国贸 | 8,473,709.43 | 0.22% |
| 16 | 002450 | 康得新 | 4,470,116.77 | 0.12% |
| 17 | 002001 | 中航光电 | 3,957,924.46 | 0.10% |
| 18 | 601318 | 中国平安 | 3,957,924.46 | 0.10% |
| 19 | 300070 | 雷沃重工 | 2,962,929.56 | 0.08% |
| 20 | 002285 | 世联行 | 1,401,156.02 | 0.04% |

注:本项“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。

7.2.1.4 卖出股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600088 | 保利地产 | 121,486,862.68 | 3.16% |
| 2 | 600389 | 华孚实业 | 104,413,800.97 | 2.72% |
| 3 | 002315 | 伟星股份 | 76,566,285.38 | 1.95% |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 52,133,720.49 | 1.36% |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 51,967,024.99 | 1.33% |
| 6 | 600006 | 国电南瑞 | 49,099,667.45 | 1.28% |