(上接B168版)

经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%;其余资产投资于股指期货、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券等金融工具;权证投资占基金资产净值的0%-3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,现金或到期日在一年期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%x沪深300指数收益率+50%x中证综合债指数收益率。

8.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则《第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》;修订了《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本财务报表无重大影响。

8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2014年12月31日的财务状况以及2014年11月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

8.4.4 重要会计政策和会计估计

8.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2014年11月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止。

8.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

8.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资等;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

8.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该金融资产已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已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的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既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的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

8.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产的金融资产,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次: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。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下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,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值;估值日无市价,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,按最近交易市价确定公允价值;如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值;

(2)不存在活跃市场的金融工具,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。本基金采用在当前情况下适用并且具有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术,优先使用相关可观察输入值,只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能适当反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

8.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

8.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

8.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

8.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

8.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率逐日计提;

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率逐日计提;

(3)卖出回购证券支出,按卖出回购金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法。

8.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,若事先未做出选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;场内基金份额的收益分配方式为现金分红,具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及注册登记机构的相关规定;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)投资者的现金红利保留到小数点后第2位,由此产生的收益或损失由基金资产承担;

(6)当日申购的基金份额自申购确认日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自赎回确认日起,不享有基金的分配权益;

(7)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

8.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

8.4.5.1 会计政策变更的说明

会计政策变更的说明可参见7.4.2会计报表的编制基础。

8.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

8.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

8.4.6 税项

7.4.6.1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.3个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

8.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人子公司

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。

8.4.8 本报告期间的关联方交易

8.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金于2014年11月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未通过关联方交易单元进行交易。

8.4.8.2 关联方报酬

8.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年11月5日至2014年12月31日
当期应支付的管理费	9,373,695.78
其中:支付销售机构的客户维护费	52,184.70

注:基金管理费每日计提,按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

8.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年11月5日至2014年12月31日
当期应支付的托管费	1,562,282.59

注:基金托管费每日计提,按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

8.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2014年11月5日至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	30,712,227.95	-	-	-	-

8.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.8.4.1 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 2014年11月5日至2014年12月31日
期初持有的基金份额	6,000,000.00
期间申购/买入总份额	1,487,954.00
期间因拆分增加的份额	-
期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	7,487,954.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.20%

注:1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、基金管理人以2014年12月3日作为基金份额折算基准日,对折算基准日登记在册的由原基金同盛转型所得的本基金基金份额进行折算与变更登记。折算后,本基金管理人持有的基金份额调增1,487,954.00份。

8.4.8.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国元证券	3,743,978.00	0.10%

注:除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

8.4.8.5 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 2014年11月5日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	1,186,611,911.02	399,207.37

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

8.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金于2014年11月5日(基金合同生效日)至2014年12月31日止期间未在承销期内参与关联方承销证券。

8.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

8.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

8.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000883	湖北能源	2014年11月18日	重大事项未公告	8.31	-	-	8,579,466	28,830,013.93	71,295,362.46	-
002170	芭田股份	2014年12月26日	重大事项未公告	9.00	2015年1月5日	9.38	4,700,522	44,938,156.35	42,304,698.00	-
002207	准油股份	2014年10月10日	重大事项未公告	20.36	2015年1月7日	16.02	3,194,245	46,312,933.00	65,034,828.20	-
300296	利亚德	2014年9月29日	重大资产重组	21.95	2015年1月5日	22.60	6,696,572	103,270,310.09	146,989,755.40	-
300324	旋极信息	2014年10月15日	重大事项未公告	53.82	2015年1月15日	50.00	1,332,841	59,426,581.54	71,733,502.62	-
000411	英特集团	2014年11月28日	重大资产重组	21.70	-	-	1,541,915	23,064,869.89	33,459,555.50	-

8.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

8.4.5 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公允价值

银行存款、结算备付金、应收证券清算款、应付证券清算款、应付赎回款等,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币2,619,614,381.27元,属于第二层次的余额为人民币430,817,702.18元,属于第三层次的余额为人民币零元。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,由第一层次转入第二层次的金额为人民币414,771,448.77元,由第二层次转入第一层次的金额为人民币280,347,370.03元。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

7.4.14.2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。

7.4.14.3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。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2015年3月24日经本基金的基金管理人批准。

§9 投资组合报告(转型前)

9.1 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	2,679,138,801.60	77.17
	其中:股票	2,679,138,801.60	77.17
2	固定收益投资	720,389,453.80	20.75
	其中:债券	720,389,453.80	20.75
	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	55,847,978.19	1.61
7	其他资产	16,350,551.15	0.47
8	合计	3,471,726,784.74	100.00

9.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	28,399,661.72	0.82
B	采矿业	126,616,624.43	3.65
C	制造业	1,306,754,848.55	37.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	98,364,720.72	2.84
E	建筑业	213,605,179.98	6.16
F	批发和零售业	228,618,402.85	6.59
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	491,931,597.09	14.19
J	金融业	119,513,504.53	3.45
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,111,244.88	0.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	48,223,016.85	1.39
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,679,138,801.60	77.27

9.3 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	300010	立思辰	5,916,987	165,320,616.78	4.77
2	300296	利亚德	6,696,572	155,494,401.84	4.48
3	601555	东吴证券	7,875,749	98,604,377.48	2.84
4	000883	湖北能源	16,728,694	98,364,720.72	2.84
5	000333	美的集团	4,441,945	91,726,164.25	2.65
6	002713	东易日盛	2,005,917	91,710,525.24	2.65
7	600133	东湖高新	9,516,363	85,837,594.26	2.48
8	300003	乐普医疗	2,899,772	79,076,782.44	2.28
9	001696	宗申动力	8,177,353	78,257,268.21	2.26
10	000100	TCL集团	22,399,992	73,471,973.76	2.12

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http://www.csfunds.com.cn网站的年度报告正文。

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 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	000333	美的集团	326,652,498.64	9.75
2	601555	东吴证券	218,292,675.32	6.52
3	600886	国投电力	189,377,129.19	5.65
4	300296	利亚德	187,853,630.46	5.61
5	300010	立思辰	186,297,645.17	5.56
6	600584	长电科技	153,388,954.80	4.58
7	600887	伊利股份	148,317,493.89	4.43
8	300291	华录百纳	136,226,293.41	4.07
9	600893	航空动力	128,426,054.85	3.83
10	600837	海通证券	127,610,195.74	3.81
11	601299	中国北车	119,540,588.71	3.57
12	600037	歌华有线	117,121,291.89	3.50
13	002373	联信永益	111,522,143.57	3.33
14	600015	华夏银行	107,767,642.98	3.22
15	300081	恒信移动	106,610,426.45	3.18
16	601688	华泰证券	102,870,817.98	3.07
17	002229	鸿博股份	102,613,777.22	3.06
18	000625	长安汽车	100,150,592.17	2.99
19	600999	招商证券	99,885,352.10	2.98
20	000712	锦龙股份	93,097,576.51	2.78
21	002713	东易日盛	90,296,710.16	2.70
22	601601	中国太保	90,290,850.84	2.69
23	002111	威海广泰	89,191,286.83	2.66
24	601600	中国铝业	87,268,626.11	2.60
25	300104	乐视网	85,117,600.79	2.54
26	601336	新华保险	83,206,242.63	2.48
27	002347	泰尔重工	82,521,050.79	2.46
28	600133	东湖高新	80,871,838.59	2.41
29	600446	金证股份	79,475,880.10	2.37
30	600122	宏图高科	78,609,173.92	2.35
31	300150	世纪瑞尔	77,646,964.01	2.32
32	300002	神州泰岳	75,288,705.14	2.25
33	002383	合众思壮	72,836,414.53	2.17
34	600535	天士力	70,196,839.28	2.10
35	001696	宗申动力	69,987,232.10	2.09
36	000883	湖北能源	69,265,627.77	2.07
37	300219	鸿利光电	68,798,537.97	2.05
38	000739	普洛药业	67,805,545.82	2.02

9.4.2 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	000333	美的集团	315,796,332.77	9.43
2	600886	国投电力	200,483,825.23	5.98
3	600309	万华化学	190,463,583.44	5.68
4	600887	伊利股份	183,415,075.34	5.47
5	002038	双鹭药业	168,420,763.62	5.03
6	601555	东吴证券	165,059,756.80	4.93
7	300291	华录百纳	154,370,637.42	4.61
8	600104	上汽集团	146,339,747.85	4.37
9	600584	长电科技	136,854,530.95	4.08
10	000661	长春高新	121,966,273.44	3.64
11	600837	海通证券	119,229,859.02	3.56
12	000625	长安汽车	119,013,231.43	3.55
13	601299	中国北车	113,840,833.96	3.40
14	600690	青岛海尔	112,731,351.96	3.36
15	002373	联信永益	110,796,171.93	3.31
16	002229	鸿博股份	110,460,827.79	3.30
17	002111	威海广泰	109,716,699.20	3.27
18	000538	云南白药	107,734,873.12	3.22
19	600015	华夏银行	104,066,773.80	3.11
20	300296	利亚德	103,682,664.37	3.09
21	000895	双汇发展	93,221,629.63	2.78
22	601601	中国太保	92,153,953.78	2.75
23	601688	华泰证券	91,954,807.92	2.74
24	600999	招商证券	91,228,776.31	2.72
25	601600	中国铝业	91,179,161.72	2.72
26	000712	锦龙股份	88,610,945.81	2.64
27	600893	航空动力	88,560,100.73	2.64
28	300017	网宿科技	87,679,915.56	2.62
29	601098	中南传媒	86,207,943.86	2.57
30	002508	老板电器	86,206,089.23	2.57
31	601336	新华保险	84,627,589.16	2.53
32	300150	世纪瑞尔	82,179,841.00	2.45
33	300104	乐视网	80,893,944.11	2.41
34	600446	金证股份	79,929,566.21	2.39
35	600519	贵州茅台	78,901,467.40	2.35
36	600037	歌华有线	77,677,881.96	2.32
37	600674	川投能源	77,314,506.88	2.31
38	002410	广联达	75,752,656.17	2.26
39	300113	顺网科技	73,281,783.89	2.19
40	300002	神州泰岳	69,937,751.63	2.09
41	300024	机器人	69,762,458.39	2.08
42	002714	牧原股份	68,534,277.00	2.05
43	300219	鸿利光电	68,074,852.55	2.03

9.4.3 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	10,619,972,179.81
卖出股票收入(成交)总额	10,528,551,973.77

注:本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的“买入金额”(或“买入股票成本”)、“卖出金额”(或“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。

9.5 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	138,076,453.80	3.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	582,313,000.00	16.80
	其中:政策性金融债	582,313,000.00	16.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	720,389,453.80	20.78

9.6 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	100209	10国开09	1,500,000	150,690,000.00	4.35
2	140218	14国开18	1,500,000	150,570,000.00	4.34
3	018002	国开1302	963,720	103,069,854.00	2.97
4	140212	14国开12	700,000	70,308,000.00	2.03
5	100230	10国开30	500,000	50,450,000.00	1.46

9.7 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。

9.8 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贵金属。

9.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

9.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无股指期货投资。

9.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

9.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

9.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

9.11