（上接B104版）

分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。因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。

7.2.4.4.8损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.2.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(适用于企业债和可转债等)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的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。

7.2.4.4.10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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.2.4.4.11基金的收益分配政策

本基金分级运作期满并转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)后，每一基金份额享有同等分配权。场外份额收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式。基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利。场内份额收益分配只采用现金红利一种方式，基金份额持有人不能自行选择。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。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10%。基金红利发放日距离收益分配基准日(即可供分配利润计算截止日)的时间不得超过15个工作日。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.2.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)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《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易价盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易价盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.2.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.2.4.5.1会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.2.4.5.2会计估计变更的说明

根据上海证券交易所2015年3月26日起，对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格进行估值。于2015年3月26日，相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.2.4.5.3差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.2.4.6税项

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于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》、财税[2005]102号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.2.4.7重要财务报表项目的说明

7.2.4.7.1银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	3,188,795.19
定期存款	-
其他存款	-
合计	3,188,795.19

7.2.4.7.2交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		15,159,214.18	21,511,754.38	6,352,540.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		15,159,214.18	21,511,754.38	6,352,540.20

7.2.4.7.3衍生金融资产/负债

本报告期末(2015年12月31日)本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.2.4.7.4买入返售金融资产

7.2.4.7.4.1各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末(2015年12月31日)本基金未持有买入返售金融资产。

7.2.4.7.4.2期末定断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末(2015年12月31日)本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.2.4.7.5应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	616.06
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	8.80
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	6.16
合计	631.06

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息。

7.2.4.7.6其他资产

本报告期末(2015年12月31日)本基金未持有其他资产。

7.2.4.7.7应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,604.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,604.57

7.2.4.7.8其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	246.02
预提信息披露费	30,000.00
指数使用费	1,223.81
预提审计费	65,000.00
合计	96,469.83

7.2.4.7.9实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	18,332,807.68	17,150,609.79
本期申购	19,847,082.74	18,568,203.28
本期赎回(以“-”号填列)	-26,159,798.53	-24,473,511.37
基金拆分/份额折算前		
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	12,020,101.89	11,245,301.70

7.2.4.7.10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
基金合同生效日	7,632,313.90	6,887,957.09	14,520,270.99
本期利润	804,027.93	-7,113,115.73	932,912.20
本期基金份额交易产生的变动数	-4,333,189.00	2,175,883.03	-2,157,296.97
其中：基金申购款	14,218,873.15	14,383,609.08	28,602,482.23
基金赎回款	-18,552,062.15	-12,207,726.05	-30,759,779.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,349,161.83	1,950,724.39	13,299,886.22

7.2.4.7.11存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
活期存款利息收入	18,725.64
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	275.46
其他	118.38
合计	19,119.48

注：此处其他列示的是基金申购款滞留利息及结算保证金利息收入。

7.2.4.7.12股票投资收益

7.2.4.7.12.1股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,385,892.54
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	8,385,892.54

7.2.4.7.12.2股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	30,032,078.48
减：卖出股票成本总额	21,646,185.94
买卖股票差价收入	8,385,892.54

7.2.4.7.13债券投资收益

7.2.4.7.13.1债券投资收益项目构成

本基金本期无债券投资收益。

7.2.4.7.13.2债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本期无债券投资收益买卖债券差价收入。

7.2.4.7.13.3债券投资收益——赎回差价收入

本基金本期无债券投资收益赎回差价收入。

7.2.4.7.13.4债券投资收益——申购差价收入

本基金本期无债券投资收益申购差价收入。

7.2.4.7.14衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.2.4.7.15股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	151,255.36
基金投资产生的股利收益	-
合计	151,255.36

7.2.4.7.16公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-7,113,115.73
——股票投资	-7,113,115.73
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	-7,113,115.73

7.2.4.7.17其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
基金赎回费收入	66,847.19
转换费收入	119.13
合计	66,966.32

注：本基金赎回费和转换费的25%归入基金资产。

7.2.4.7.18交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	80,748.06
银行间市场交易费用	0.00
合计	80,748.06

7.2.4.7.19其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
审计费用	62,644.24
信息披露费	23,280.42
银行划款费用	2,289.62
上市费	40,000.00
指数使用费	154,429.10
合计	272,623.38

7.2.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.2.4.8.1或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.2.4.8.2资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.2.4.9关联方关系

7.2.4.9.1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，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.2.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安”)	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东
中德安联人寿保险有限公司(“中德安联”)	基金管理人的股东控制的公司

7.2.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.2.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.2.4.10.1.1股票交易

本报告期内，本基金与关联方无股票交易。

7.2.4.10.1.2权证交易

本报告期内，本基金与关联方无权证交易。

7.2.4.10.1.3债券交易

本报告期内，本基金与关联方无债券交易。

7.2.4.10.1.4债券回购交易

本报告期，本基金与关联方无债券回购交易。

7.2.4.10.1.5应支付关联方的佣金

本报告期内，本基金无支付关联方的佣金。

7.2.4.10.2关联方报酬

7.2.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	173,067.78
其中：支付销售机构的客户维护费	40,311.95

注：在本基金分级运作期到期后，支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

7.2.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年3月24日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	50,766.56

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

7.2.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内，本基金未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

7.2.4.10.4各关联方投资本基金的情况

7.2.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未投资本基金。

7.2.4.10.4.2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

本期末，其他关联方均未投资本基金。

7.2.4.10.5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 2015年3月24日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	3,188,795.19	18,725.64

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计算。

7.2.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.1.4.1利润分配情况

本基金在自2015年3月24日(转型后首日)至2015年12月31日止期间未进行过利润分配。

7.2.4.12期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.2.4.12.1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(2015年12月31日)未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

7.2.4.12.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002006	精功科技	2015-12-11	重大事项停牌	14.70	-	-	3,298.00	52,207.34	48,480.60	-
002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项停牌	16.72	2016-02-22	15.05	2,644.00	26,825.00	44,207.68	-
002018	华信国际	2015-06-15	重大事项停牌	44.08	-	-	2,196.00	8,738.74	96,799.68	-
002020	京新药业	2015-12-29	重大事项停牌	33.55	2016-01-20	30.20	1,382.00	8,353.70	46,366.10	-
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大事项停牌	17.40	-	-	1,69.00	14,994.12	28,866.60	-
002053	云南盐化	2015-11-19	重大事项停牌	25.84	2016-03-14	23.26	1,573.00	14,900.37	40,646.32	-
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项停牌	25.10	-	-	4,700.00	98,413.85	117,970.00	-
002075	沙钢股份	2015-06-25	重大事项停牌	13.89	2016-01-21	21.21	12,180.00	294,930.00	169,180.20	-
002109	兴化股份	2015-05-08	重大事项停牌	8.54	2016-01-04	9.39	3,465.00	26,919.50	29,591.10	-
002143	印纪传媒	2015-12-09	重大事项停牌	40.55	2016-01-06	36.50	1,000.00	22,040.00	40,550.00	-
002147	方圆支承	2015-06-01	重大事项停牌	17.90	2016-01-12	16.11	2,699.00	19,290.67	48,312.10	-
002174	游族网络	2015-07-23	重大事项停牌	84.39	2016-02-15	80.58	700.00	71,400.00	59,073.00	-
002201	九鼎新材	2015-11-17	重大事项停牌	16.01	-	-	1,900.00	10,996.98	30,419.00	-
002209	达意隆	2015-11-24	重大事项停牌	22.91	-	-	1,300.00	19,068.00	29,783.00	-
002219	恒康医疗	2015-07-08	重大事项停牌	18.18	-	-	7,212.00	52,758.48	131,114.16	-
002228	合兴包装	2015-08-04	重大事项停牌	16.88	2016-02-02	15.21	2,523.00	34,023.74	42,588.24	-
002231	奥维通信	2015-12-03	重大事项停牌	16.36	2016-03-17	16.00	1,600.00	19,264.00	26,176.00	-
002240	威华股份	2015-12-28	重大事项停牌	13.68	2016-01-22	12.31	2,429.00	21,818.97	33,228.72	-
002242	九阳股份	2015-12-24	重大事项停牌	22.68	2016-01-11	20.41	2,400.00	57,600.00	54,432.00	-
002320	海峡股份	2015-06-26	重大事项停牌	27.43	2016-01-07	24.69	2,433.00	23,308.14	66,737.19	-
002340	格林美	2015-12-29	重大事项停牌	15.20	2016-01-06	14.35	1,000.00	11,384.47	15,200.00	-
002360	同德化工	2015-12-03	重大事项停牌	12.32	2016-01-05	11.09	1,901.00	7,517.17	23,420.32	-
002371	七星电子	2015-10-08	重大事项停牌	19.28	2016-01-11	21.21	2,300.00	129,030.00	44,344.00	-
002435	长江润发	2015-07-06	重大事项停牌	10.06	2016-01-27	11.07	2,769.00	19,963.46	27,856.14	-
002465	海格通信	2015-12-30	重大事项停牌	16.69	2016-02-04	15.02	6,174.00	141,847.65	103,044.06	-
002481	双塔食品	2015-07-07	重大事项停牌	13.88	2016-01-04	12.49	5,000.00	82,000.00	69,400.00	-
002483	润邦股份	2015-09-30	重大事项停牌	11.53	2016-03-11	10.38	3,587.00	89,316.30	41,358.11	-
002485	希努尔	2015-09-08	重大事项停牌	15.14	-	-	3,025.00	34,543.09	45,798.50	-
002502	骅威股份	2015-08-20	重大事项停牌	32.02	2016-01-14	23.35	1,526.00	40,859.09	48,862.52	-
002537	海立美达	2015-08-17	重大事项停牌	16.59	2016-02-18	18.25	3,452.00	23,912.84	57,268.68	-
002544	杰赛科技	2015-08-31	重大事项停牌	29.65	-	-	2,126.00	33,080.12	63,035.90	-
002467	唐人神	2015-11-24	重大事项停牌	12.84	2016-02-25	11.56	3,277.00	27,250.10	42,076.68	-
002612	朗姿股份	2015-12-23	重大事项停牌	75.46	-	-	721.00	22,092.06	54,406.66	-
002622	永大集团	2015-07-02	重大事项停牌	25.28	2016-01-08	27.81	1,677.00	8,568.23	42,394.56	-
002631	德尔未来	2015-11-27	重大事项停牌	29.07	-	-	1,928.00	6,920.20	56,046.96	-
002638	勤上光电	2015-08-31	重大事项停牌	15.32	2016-01-19	16.85	2,699.00	44,992.52	39,816.68	-
002647	宏磊股份	2015-11-17	重大事项停牌	23.84	-	-	1,032.00	7,922.66	24,602.88	-
002664	信质电机	2015-12-30	重大事项停牌	31.77	2016-03-08	28.59	1,452.00	37,796.55	46,130.04	-
002678	珠江钢琴	2015-12-21	重大事项停牌	17.21	2016-01-19	15.49	3,382.00	67,403.26	58,204.22	-
002696	百洋股份	2015-12-02	重大事项停牌	24.97	-	-	1,061.00	11,846.65	26,493.17	-

7.2.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.2.4.12.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元，因此没有作为抵押的债券。

7.2.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2015年12月31日)止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额0元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§8投资组合报告

8.1 国联安双力中小板综指分级证券投资基金

8.1.1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	29,588,092.96	91.99
	其中：股票	29,588,092.96	91.99
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	1,456,596.02	4.53
7	其他各项资产	1,119,568.29	3.48
8	合计	32,164,257.27	100.00

8.1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

8.1.2.1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	441,133.70	1.39
B	采矿业	282,094.71	0.89
C	制造业	21,363,003.79	67.46
D	电力，热力，燃气及水生产和供应业	298,907.38	0.82
E	建筑业	1,447,185.07	4.57
F	批发和零售业	1,341,159.14	4.23
G	交通运输，仓储和邮政业	231,524.69	0.73
H	住宿和餐饮业	46,124.60	0.15
I	信息传输，软件和信息技术服务业	1,940,117.48	6.13
J	金融业	913,635.54	2.88
K	房地产业	742,432.11	2.34
L	租赁和商务服务业	482,824.16	1.52
M	科学研究和技术服务业	49,340.00	0.16
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	48,618.92	0.15
S	综合	-	-
	合计	29,588,092.96	93.42

8.1.2.2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持有沪港通股票投资。

8.1.3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	002415	海康威视	18,003	537,389.55	1.70
2	002304	洋河股份	5,103	404,259.66	1.28
3	002024	苏宁云商	28,228	366,117.16	1.16
4	002252	上海莱士	5,688	302,032.80	0.95
5	002081	金螳螂	10,340	299,446.40	0.95
6	002142	宁波银行	16,475	297,209.00	0.94
7	002065	东华软件	8,300	274,066.00	0.87
8	002500	山西证券	14,250	240,397.50	0.76
9	002241	歌尔声学	7,055	227,876.50	0.72
10	002594	比亚迪	4,114	218,494.54	0.69

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

8.1.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.1.4.1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

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002241	歌尔声学	314,848.00	1.17
2	002736	国信证券	234,118.00	0.87
3	002567	唐人神	146,075.00	0.54
4	002415	海康威视	134,310.14	0.50
5	002304	洋河股份	102,192.00	0.38
6	002031	巨轮股份	101,042.00	0.38
7	002187	广百股份	90,564.00	0.34
8	002089	新海宜	84,881.00	0.32
9	002095	生意宝	69,842.00	0.26
10	002594	比亚迪	67,923.00	0.25
11	002565	上海绿新	67,668.00	0.25
12	002252	上海莱士	65,608.00	0.24
13	002024	苏宁云商	58,497.00	0.22
14	002142	宁波银行	57,366.00	0.21
15	002605	姚记扑克	57,063.96	0.21
16	002543	万和电气	56,088.00	0.21
17	002649	博彦科技	53,911.00	0.20
18	002433	太安堂	53,040.00	0.20
19	002195	二三四五	53,016.00	0.20
20	002520	日发精机	50,466.00	0.19

8.1.4.2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

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	284,785.38	1.06
2	002304	洋河股份	220,389.87	0.82
3	002024	苏宁云商	175,468.49	0.65
4	002252	上海莱士	138,479.92	0.51
5	002142	宁波银行	122,004.66	0.46
6	002557	洽洽食品	106,749.99	0.40
7	002241	歌尔声学	105,367.06	0.39
8	002500	山西证券	103,947.92	0.39
9	002081	金螳螂	99,508.16	0.37
10	002594	比亚迪	96,014.26	0.36
11	002460	赣锋锂	89,284.02	0.33
12	002196	二三四五	89,281.00	0.33
13	002202	金风科技	87,362.00	0.33
14	603301	振德医疗	85,081.34	0.32
15	002649	博彦科技	84,838.00	0.32
16	002051	中工国际	84,776.14	0.32
17	002065	东华软件	80,512.34	0.30
18	002363	隆基机械	76,573.73	0.29
19	002196	方正科技	74,005.50	0.28
20	002303	美盈森	72,643.08	0.27

8.1.4.3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

买入股票的成本(成交)总额	4,004,502.33
卖出股票的收入(成交)总额	9,786,671.81

8.1.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.1.6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

本基金本报告期末未持有债券。

8.1.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.1.8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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.1.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.1.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货，没有相关投资政策。

8.1.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1.11.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

8.1.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.1.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

8.1.12投资组合报告附注

8.1.12.1本报告期内，双力分级投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.1.12.2双力分级投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.1.12.3期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,847.48
2	应收证券清算款	882,009.29
3	应收股利	-
4	应收利息	461.06
5	应收申购款	228,642.13
6	其他应收款	4,608.23
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,119,568.29

8.1.12.4期末持