广发轮动配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

广发轮动配置混合型证券投资基金
2015年年度报告摘要
2015年12月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月22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2015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	广发轮动配置混合
基金主代码	000117
交易代码	000117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月28日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	887,032,055.89份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	根据经济周期中不同阶段的特征，通过大类资产配置及行业轮动策略，投资相应的受益资产，应对通货膨胀、通货紧缩、经济衰退和萧条等宏观经济波动的冲击，为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	在经济上升周期增加股票配置，重点配置受益于经济和通货膨胀的行业及个股；在经济下降周期减少股票配置，阶段重点配置相对稳定类和抗通胀的行业及个股。根据经济和通胀的各阶段变化情况，把握经济周期与行业板块轮动之间规律，通过各行业之间的比较，进行行业轮动以降低风险，同时精选个股，实现基金资产长期稳定的投资回报。
业绩比较基准	80%×沪深300指数＋20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	洪渊
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

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.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	–

注:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§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	2015年	2014年	2013年5月28日(基金合同生效日)至2013年12月31日
本期已实现收益	30,838,531.14	180,490,927.04	-15,007,974.68
本期利润	182,791,238.11	137,323,284.56	19,165,788.64
加权平均基金份额本期利润	0.2105	0.1332	0.0061
本期基金份额净值增长率	73.39%	1.10%	0.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.3525	0.0111	-0.0128
期末基金资产净值	1,555,162,358.78	349,026,177.69	2,488,449,462.29
期末基金份额净值	1.753	1.011	1.000

注:(1)上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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)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。

(3)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)。

3.2 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	27.49%	2.18%	13.74%	1.34%	13.75%	0.84%
过去六个月	1.39%	2.98%	-12.19%	2.14%	13.58%	0.84%
过去一年	73.39%	2.93%	6.21%	1.99%	67.18%	0.94%
自基金合同生效起至今	75.30%	2.09%	38.01%	1.47%	37.29%	0.62%

注:(1)业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。

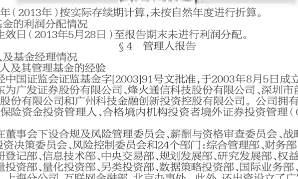
(2)业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发轮动配置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
(2013年5月28日至2015年12月31日)

3.2.3 自基金合同生效以来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

广发轮动配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年(2013年)按实际存续期计算，未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2013年5月28日)至报告期末未进行利润分配。

§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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，于2003年8月5日成立，注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理人(QDII)和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和24个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至2015年12月31日，本基金管理人管理八十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债券型证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场外实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币市场基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为3300.24亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
吴兴武	本基金的基金经理;广发核心精选混合基金的基金经理	2015-02-12	–	6年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，自2009年7月至2010年7月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任职，从事上市公司及行业研究工作，2010年7月20日至2015年2月先后在广发基金管理有限公司研究发展部和权益投资一部任研究员，2015年2月12日起任广发轮动配置混合基金的基金经理，2015年2月17日起任广发核心精选混合基金的基金经理。
朱纪刚	本基金的基金经理;广发核心精选股票基金的基金经理;广发成长优选混合基金的基金经理;广发竞争优势混合基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2013-05-28	2015-02-17	9年	男，中国籍，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2006年7月至2006年12月任职于招商证券股份有限公司，2006年12月至2009年7月先后任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究小组组长、广发大盘成长混合基金的基金经理助理，研究发展部副总经理，2009年7月调入投资管理部，2009年9月10日至2015年2月16日任广发核心精选股票基金的基金经理，2011年3月15日至2012年10月22日任广发聚祥保本混合基金的基金经理，2013年5月28日至2015年2月16日任广发轮动配置股票基金的基金经理，2013年12月11日至2015年2月16日任广发成长优选混合基金的基金经理，2014年1月21日至2015年2月16日任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理，2014年3月12日至2015年2月16日任广发竞争优势混合基金的基金经理。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发轮动配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则，公平分配投资指令。公司原则上禁止不同投资组合间的同日反向交易(指数型基金除外)；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

2015年的市场分为三个阶段:第一阶段从年初到6月中旬，市场延续上一年度的上涨趋势，上涨的主要方向由前一阶段的周期蓝筹转为以互联网为代表的新兴产业；第二阶段从6月中旬到8月底，市场经历了股灾1.0和股灾2.0，主板和创业板分别下跌约45%和55%；第三阶段从9月初到年底，主板和创业板分别修复了20%和50%。尽管经历了反差极大的若干阶段，但是从全年来看，创业板指数仍然上涨84.4%，远远强于上证指数9.4%的涨幅。这表明在过去的一年里，市场仍然对风险偏好较高的特定一类股票更为追捧。

如果将时间跨度拉长到过去十年，按照市场风格来划分，也可以分为三个阶段:第一阶段是从2006年到2008年初，以地产金融煤炭钢铁为代表的周期股全面领涨；第二阶段是从2009年到2013年，以业绩连续几年高成长为特征的成长股是机构的主流赚钱方式，这种投资方式在行业上以消费与医药为主、估值波动为辅的成长股，我们称之为经典成长股；第三阶段横跨2014-2015两年，以互联网、VR等为代表的高弹性股票成为涨幅最大的一类股票，这类股票的特征是短期内看不到业绩增长，但是能够讲出巨大的市场空间和性感的商业模式，我们称之为弹性成长股。

如果考虑跨越较长的时间维度，我们认为经典成长股能够持续稳定的为我们带来长期收益。在上述不同阶段，尽管市场风格偏好迥异，但是也有很多相通之处。第一阶段的价值股，其实是当年的成长股；第二阶段的弹性成长股，其实是经典成长股的延伸。

在过去的两年里，由于宏观经济持续走弱、宽货币宽信用并叠加较强的改革转型预期，无论是流动性还是市场情绪，都为股市提供一个温和的外部环境。在这种环境下，市场的风险偏好会发提升，在2015年上半年，这种趋势在以互联网为代表的高弹性板块的表现下得到了最好的体现。

基金经理认为此轮牛市的驱动因素是流动性和改革预期，但是在年度中期对去杠杆过程导致流动性枯竭的影响预计不足，因此在6月中下旬指数断崖式下跌的初期没能及时察觉并做出应对，这导致在股灾1.0期间，净值出现了较大幅度回撤。8月份，基金经理认为上一阶段的牛市已经全面结束，但是个股层面仍然有非常明显的机会，因此适当降低仓位并将核心仓位转移到估值与增长较为匹配的经典成长股中，这样的策略在八月中下旬的股灾2.0过程中起到一定效果，期间净值明显跑赢基准。9月到11月的上涨是超跌以后的恢复性上涨，部分个股重新回到较为高估的水平，但是热点较为散乱，并不代表牛市重新开始。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为73.39%，同期业绩比较基准收益率为6.21%。

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2016年，由于对改革牛转型牛的憧憬逐渐退去，相对2015年集中于创新和转型的掏空式挖掘，市场的着眼点将更多回归到宏观经济走势、国际和国内金融政策变化、公司估值增长等基本面因素。

国内方面，经济仍然持续走弱，钢铁煤炭等传统产业盈利持续下滑，相比过去几年，我们会加大关注供给侧改革对传统行业的影响力度。我们认为供给侧改革带来的去产能不会一蹴而就，稳增长的压力会让去产能的过程变得曲折，因此煤炭钢铁等行业大概率不会贯穿全年具备相对收益，但是我们会更加关注这类行业每个时间段的行业数据，尤其是价格与季节性因素是否出现明显背离这类明显信号，适时适度把握这类板块在今年的阶段性机会。

我们持续关注创新转型，创新创业其实已经在过去几年持续活跃，并且会继续活跃，我们认为外延并购是小市值传统上市公司转型的切实可行的方式。需要指出的是，市场对创新的期待已经较为充分或者阶段性预期过高，我们会加强研究深度，寻找有预期差、尚未被过高预期的公司。

海外经济形势、金融政策是今年影响A股市场的新增变量。坦白的讲，就我们目前对以美国为代表的海外经济体的认知深度，很难对例如美元加息和人民币汇率变化的具体节奏等事件做出有把握的长期判断。一方面，我们会加强对其跟踪的力度，因为从全球金融联动的角度来看，这些因素可能会造成今年A股市场阶段性波动；另一方面，我们预计A股相当一部分股票的走势受海外因素的影响会逐步淡化。

市场的运行规律，从不同的维度、时间跨度评估，会有不同的主线和逻辑。我们希望能够较为全面的对影响市场的因素做出展望，在操作上适度做好风险控制；但是更为核心的，我们仍然坚持以经典成长股投资为主线的长期投资框架，积极寻找成长性行业中的优秀公司，获取长期超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保相关程序和政策得到严格的遵守。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中"基金收益与分配"之"(三)基金收益分配原则"的相关规定，本基金本年度未进行利润分配，符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发轮动配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发轮动配置混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发轮动配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发轮动配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发轮动配置混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第P0747号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:广发轮动配置混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:	–	–
银行存款	155,084,275.17	40,006,664.94
结算备付金	7,389,461.33	2,202,423.98
存出保证金	1,514,295.21	414,439.69
交易性金融资产	1,414,375,316.33	309,299,882.21
其中:股票投资	1,414,375,316.33	309,299,882.21
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	–
应收证券清算款	–	512.23
应收利息	28,115.29	10,231.72
应收股利	–	–
应收申购款	1,979,949.15	13,394,310.33
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	1,580,371,412.48	365,328,465.10
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:	–	–
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	11,709,460.12	6,858,753.91
应付赎回款	3,160,439.91	5,358,635.51
应付管理人报酬	1,967,816.66	616,815.14
应付托管费	327,969.42	102,802.51
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	7,705,840.64	2,954,727.46
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	337,526.95	410,552.88
负债合计	25,209,053.70	16,302,287.41
所有者权益:	–	–
实收基金	887,032,055.89	345,207,022.72
未分配利润	668,130,302.89	3,819,154.97
所有者权益合计	1,555,162,358.78	349,026,177.69
负债和所有者权益总计	1,580,371,412.48	365,328,465.10

注:报告截止日2015年12月31日，基金份额净值人民币1.753元，基金份额总额887,032,055.89份。

7.2 利润表

会计主体:广发轮动配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	238,058,718.52	173,539,849.11
1.利息收入	1,726,510.99	979,231.42
其中:存款利息收入	1,726,510.99	972,286.96
债券利息收入	–	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	–	6,944.46
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	76,000,798.73	211,959,037.03
其中:股票投资收益	73,069,242.57	208,485,571.32
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	2,931,556.16	3,473,465.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	151,952,706.97	-43,167,642.48
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	8,378,701.83	3,769,223.14
减:二、费用	55,267,480.41	36,216,564.55
1. 管理人报酬	21,683,849.80	16,238,669.05
2. 托管费	3,613,974.97	2,706,444.83
3. 销售服务费	–	–
4. 交易费用	29,596,953.79	16,845,033.24
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 其他费用	372,701.85	426,417.43
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	182,791,238.11	137,323,284.56
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	182,791,238.11	137,323,284.56

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发轮动配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	345,207,022.72	3,819,154.97	349,026,177.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	182,791,238.11	182,791,238.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	541,825,033.17	481,519,909.81	1,023,344,942.98
其中:1.基金申购款	3,503,428,816.50	3,045,702,461.09	6,549,131,277.59
2.基金赎回款	-2,961,603,783.33	-2,564,182,551.28	-5,525,786,334.61
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	887,032,055.89	668,130,302.89	1,555,162,358.78
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,487,528,935.33	920,526.96	2,488,449,462.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	137,323,284.56	137,323,284.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-2,142,321,912.61	-134,424,656.55	-2,276,746,569.16
其中:1.基金申购款	872,003,108.36	34,771,144.48	906,774,252.84
2.基金赎回款	-3,014,325,020.97	-169,195,801.03	-3,183,520,822.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	345,207,022.72	3,819,154.97	349,026,177.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:王志伟，主管会计工作负责人:窦刚，会计机构负责人:张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发轮动配置混合型证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2013]307号文《关于同意广发轮动配置股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发轮动配置股票型证券投资基金基金合同》(后更新为《广发轮动配置混合型证券投资基金基金合同》，以下简称"基金合同")发起，于2013年5月28日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为2013年4月26日至2013年5月24日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次募集资金为人民币4,034,601,387.29元，有效认购户数为36,670户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币353,082.75元，折合基金份额353,082.75份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，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)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券等)、权证、货币市场工具、股指期货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。本基金业绩比较基准:80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。

根据中国证监会相关规定，本基金自2015年8月7日起由股票型基金变更为混合型基金，基金名称由"广发轮动配置股票型证券投资基金"变更为"广发轮动配置混合型证券投资基金"。

本基金的财务报表于2016年3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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的说明

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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，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")，本基金自2015年3月17日起，对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的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，估值处理标准另有规定的除外。于2015年3月17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%。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[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》、财税[2015]101号《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》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，不缴纳营业税。

2.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，暂不缴纳企业所得税。

3.对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人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，其中股权登记日在2015年9月8日之前的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由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，暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.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、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:本报告期内不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	7,777,157.20	0.04%	316,222,308.55	2.86%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	7,242.94	0.04%	7,242.94	0.09%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	287,889.32	3.16%	17,116.87	0.58%

注:1、股票交易佣金的计提标准:支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,683,849.80	16,238,669.05
其中:支付销售机构的客户维护费	7,189,401.98	3,538,818.84

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

H=E×1.5%÷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

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,613,974.97	2,706,444.83

注: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。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

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
报告期初持有的基金份额	–	–
报告期间申购/买入总份额	47,414,795.72	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	47,414,795.72	–
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.35%	–

注:基金管理人本报告期内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日 期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	155,084,275.17	1,558,628.25	40,006,664.94	899,087.76

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
000971	高升控股	2015-09-21	重大事项	34.97	2015-12-31	26.39	455,600.00	9,042,454.00	15,932,332.00	–
300025	华星创业	2015-11-26	重大事项	28.28	–	–	1,380,970.00	34,288,171.38	39,053,831.60	–
300063	天龙集团	2015-12-22	重大事项	43.33	–	–	188,927.00	6,514,010.87	8,186,206.91	–
300242	明家科技	2015-12-18	重大事项	49.96	2016-01-22	44.96	409,131.00	10,009,955.40	20,440,184.76	–
600682	南京新百	2015-07-01	重大事项	32.98	2016-01-27	33.78	473,473.00	10,381,458.94	15,615,139.54	–
600986	科达股份	2015-12-14	重大事项	21.67	–	–	693,562.00	11,979,798.40	15,029,488.54	–

注:此停牌股票在期末虽已复牌但交易仍不活跃，因此未采用市价估值。7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注7.4.4.5。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,300,118,132.98元，属于第二层级的余额为114,257,183.35元，无属于第三层级的余额(2014年12月31日:第一层级273,068,831.49 元，第二层级36,231,050.72元，无第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、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二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。如附注7.4.5.2所述，本基金自2015年3月17日起，对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的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层级。

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。

§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	1,414,375,316.33	89.50
	其中:股票	1,414,375,316.33	89.50
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	162,473,736.50	10.28
7	其他各项资产	3,522,359.65	0.22
8	合计	1,580,371,412.48	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	797,458,024.70	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	–
E	建筑业	62,198,964.90	4.00
F	批发和零售业	15,615,139.54	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	100,993,470.63	6.49
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	258,439,256.58	16.62
J	金融业	–	–
K	房地产业	47,463,036.00	3.05
L	租赁和商务服务业	51,020,892.30	3.28
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	14,621,689.02	0.94
R	文化、体育和娱乐业	38,836,146.60	2.50
S	综合	27,728,696.06	1.78
	合计	1,414,375,316.33	90.95

8.2.2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通过沪港通机制投资的股票。

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	600303	曙光股份	6,317,452	96,972,888.20	6.24
2	300078	思创医惠	1,514,877	73,925,997.60	4.75
3	300113	顺网科技	708,092	71,779,286.04	4.62
4	002466	天齐锂业	445,433	62,694,694.75	4.03
5	600029	南方航空	6,866,900	58,849,333.00	3.78
6	002354	天神娱乐	565,699	54,295,790.02	3.49
7	300202	聚龙股份	1,668,968	53,724,079.92	3.45
8	002183	怡亚通	1,107,705	51,020,892.30	3.28
9	600556	慧球科技	1,817,523	49,200,347.61	3.16
10	600745	中茵股份	1,158,200	47,463,036.00	3.05

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	002195	二三四五	214,917,184.91	61.58
2	002657	中科金财	172,688,130.85	49.48
3	300290	荣科科技	168,986,657.33	48.42
4	600446	金证股份	161,143,788.42	46.17
5	600029	南方航空	160,452,855.01	45.97
6	000039	中集集团	141,613,766.75	40.57
7	600115	东方航空	130,832,805.60	37.49
8	002462	嘉事堂	130,466,694.43	37.38
9	002022	科华生物	129,045,040.45	36.97
10	000948	南天信息	127,308,541.95	36.48
11	600570	恒生电子	126,867,885.23	36.35
12	002183	怡亚通	120,289,230.61	34.46
13	000838	财信发展	119,791,941.67	34.32
14	600682	南京新百	119,235,547.84	34.16
15	000503	海虹控股	116,959,487.58	33.51
16	300226	上海钢联	114,535,709.31	32.82
17	300207	欣旺达	110,706,762.20	31.72
18	300170	汉得信息	106,170,402.98	30.42
19	300070	碧水源	104,667,714.89	29.99
20	002197	证通电子	104,526,250.48	29.95
21	300253	卫宁健康	104,113,181.24	29.83
22	300085	银之杰	103,415,908.63	29.63
23	300086	康芝药业	103,407,389.40	29.63
24	002280	联络互动	100,215,028.18	28.71
25	300244	迪安诊断	99,802,907.41	28.59
26	600422	昆药集团	95,817,302.47	27.45
27	601318	中国平安	93,589,184.28	26.81
28	601818	光大银行	89,454,247.94	25.63
29	600763	通策医疗	85,970,789.78	24.63
30	600303	曙光股份	82,363,937.97	23.60
31	000590	*ST古汉	78,209,535.28	22.41
32	300380	安硕信息	77,565,593.02	22.22
33	300130	新国都	76,170,323.03	21.82
34	300136	信维通信	74,822,013.60	21.44
35	603883	老百姓	73,523,147.06	21.07
36	002573	清新环境	73,220,798.62	20.98
37	300431	暴风科技	72,374,770.20	20.74
38	002354	天神娱乐	72,225,628.55	20.69
39	002153	石基信息	71,707,541.63	20.55
40	002084	海鸥卫浴	68,959,556.50	19.76
41	601901	方正证券	68,826,813.42	19.72
42	300078	思创医惠	68,763,612.07	19.70
43	000925	众合科技	68,710,148.22	19.69
44	002020	京新药业	68,331,462.90	19.58
45	603008	喜临门	67,392,613.51	19.31
46	600804	鹏博士	66,518,471.14	19.06
47	002466	天齐锂业	66,403,649.85	19.03
48	300028	金亚科技	64,480,433.74	18.47
49	601021	春秋航空	63,798,985.03	18.28
50	601388	怡球资源	62,534,324.32	17.92
51	300202	聚龙股份	62,049,643.88	17.78
52	600571	信雅达	61,709,565.38	17.68
53	601939	建设银行	61,245,802.38	17.55
54	300013	新宁物流	60,996,949.13	17.48
55	002294	信立泰	60,823,882.28	17.43
56	002236	大华股份	57,892,626.53	16.59
57	600048	保利地产	57,466,646.78	16.46
58	300367	东方网力	57,297,665.83	16.42
59	002455	百川股份	57,114,673.93	16.36
60	300377	赢时胜	54,812,170.74	15.70
61	300155	安居宝	54,706,863.08	15.67
62	600535	天士力	54,534,308.27	15.62
63	601166	兴业银行	53,901,188.00	15.44
64	600112	天成控股	51,779,592.45	14.84
65	300113	顺网科技	51,645,858.81	14.80
66	300018	中元华电	51,622,554.90	14.79
67	002719	麦趣尔	50,367,781.12	14.43
68	000785	武汉中商	49,994,182.14	14.32
69	002556	辉隆股份	49,251,065.44	14.11
70	002315	焦点科技	47,667,284.20	13.66
71	600745	中茵股份	47,307,748.16	13.55
72	600630	交大昂立	46,862,654.69	13.43
73	002074	国轩高科	46,429,299.00	13.30
74	600556	慧球科技	45,510,827.29	13.04
75	601688	华泰证券	44,824,306.73	12.84
76	300255	常山药业	44,603,613.93	12.78
77	000025	特 力A	44,548,333.41	12.76
78	300144	宋城演艺	43,871,289.96	12.57
79	300430	诚益通	42,956,307.40	12.31
80	002594	比亚迪	42,854,120.62	12.28
81	002517	泰亚股份	41,826,000.00	11.98
82	600815	厦工股份	40,970,469.48	11.74
83	300059	东方财富	40,732,691.73	11.67
84	601377	兴业证券	40,495,155.56	11.60
85	600728	佳都科技	40,487,219.09	11.60
86	000908	景峰医药	40,076,333.00	11.48
87	600276	恒瑞医药	39,810,751.92	11.41
88	300419	浩丰科技	39,688,506.90	11.37
89	300273	和佳股份	38,897,457.51	11.14
90	002510	天汽模	38,637,926.90	11.07
91	600594	益佰制药	37,684,285.00	10.80
92	300368	汇金股份	37,673,878.02	10.79
93	300339	润和软件	37,202,149.46	10.66
94	600373	中文传媒	37,034,639.04	10.61
95	002593	日上集团	36,550,133.88	10.47
96	002256	彩虹精化	35,909,030.59	10.29
97	600016	民生银行	35,656,229.50	10.22
98	002504	弘高创意	35,128,750.75	10.06
99	300203	聚光科技	34,773,244.98	9.96
100	600185	格力地产	34,679,500.35	9.94
101	300025	华星创业	34,288,171.38	9.82
102	300033	同花顺	34,103,972.28	9.77
103	300166	东方国信	33,415,145.06	9.57
104	002659	中泰桥梁	33,367,544.64	9.56
105	600701	工大高新	33,182,620.15	9.51
106	002055	得润电子	32,643,303.42	9.35
107	600633	浙报传媒	31,905,703.81	9.14
108	600598	北大荒	31,863,614.67	9.13
109	002177	御银股份	31,725,716.42	9.09
110	601988	中国银行	31,695,413.00	9.08
111	300146	汤臣倍健	31,508,241.62	9.03
112	300263	隆华节能	31,244,588.12	8.95
113	000802	北京文化	31,178,690.32	8.93
114	300291	华录百纳	31,016,745.07	8.89
115	002310	东方园林	30,529,546.29	8.75
116	000768	中航飞机	29,729,908.10	8.52
117	300022	吉峰农机	29,496,149.93	8.45
118	300010	立思辰	29,251,795.82	8.38
119	600654	中安消	29,175,943.38	8.36
120	600520	中发科技	29,128,293.47	8.35
121	000049	德赛电池	29,083,183.18	8.33
122	002208	合肥城建	28,711,154.21	8.23
123	601628	中国人寿	28,270,740.00	8.10
124	000599	青岛双星	27,994,321.10	8.02
125	000793	华闻传媒	27,934,688.57	8.00
126	600963	岳阳林纸	26,962,958.90	7.73
127	000686	东北证券	26,682,821.20	7.64
128	000400	许继电气	26,519,303.10	7.60
129	600587	新华医疗	26,437,056.34	7.57
130	300039	上海凯宝	25,193,630.91	7.22
131	002522	浙江众成	25,016,972.90	7.17
132	002303	美盈森	24,979,938.26	7.16
133	600889	南京化纤	24,379,819.92	6.99
134	601886	江河创建	24,354,370.64	6.98
135	000721	西安饮食	24,283,013.07	6.96
136	300295	三六五网	24,195,122.28	6.93
137	600366	宁波韵升	23,884,938.20	6.84
138	000829	天音控股	23,843,906.51	6.83
139	300090	盛运环保	23,836,096.06	6.83
140	300017	网宿科技	23,641,533.87	6.77
141	300231	银信科技	23,507,310.00	6.74
142	300097	智云股份	23,503,727.42	6.73
143	300415	伊之密	23,458,772.00	6.72
144	002251	步步高	23,393,211.05	6.70
145	600496	精工钢构	23,365,177.50	6.69
146	300037	新宙邦	23,113,614.61	6.62
147	000021	深科技	22,646,195.18	6.49
148	002312	三泰控股	22,630,051.76	6.48
149	002282	博深工具	22,615,903.22	6.48
150	002751	易尚展示	22,359,532.61	6.41
151	300011	鼎汉技术	22,352,962.78	6.40
152	000593	大通燃气	21,550,011.51	6.17
153	000150	宜华健康	21,211,634.48	6.08
154	002616	长青集团	21,135,747.68	6.06
155	002038	双鹭药业	21,001,066.45	6.02
156	000423	东阿阿胶	20,989,898.87	6.01
157	002016	世荣兆业	20,906,288.17	5.99
158	600986	科达股份	20,881,955.58	5.98
159	002741	光华科技	20,601,473.50	5.90
160	300262	巴安水务	20,560,881.57	5.89
161	600146	商赢环球	20,394,831.00	5.84
162	300348	长亮科技	20,377,616.00	5.84
163	600999	招商证券	20,182,202.19	5.78
164	000801	四川九洲	20,033,991.45	5.74
165	601328	交通银行	19,972,297.47	5.72
166	600104	上汽集团	19,833,129.73	5.68
167	002482	广田股份	19,777,389.86	5.67
168	002400	省广股份	19,679,432.00	5.64
169	002620	瑞和股份	19,488,914.95	5.58
170	300298	三诺生物	19,322,118.52	5.54
171	300026	红日药业	18,884,057.88	5.41
172	300350	华鹏飞	18,744,451.42	5.37
173	002276	万马股份	17,935,360.70	5.14
174	002397	梦洁家纺	17,906,551.69	5.13
175	600893	中航动力	17,865,140.00	5.12
176	002169	智光电气	17,827,290.65	5.11
177	603128	华贸物流	17,776,843.92	5.09
178	600030	中信证券	17,678,199.71	5.07
179	002047	宝鹰股份	17,523,781.00	5.02
180	000858	五 粮 液	17,517,685.60	5.02
181	300342	天银机电	17,445,488.00	5.00
182	600536	中国软件	17,438,355.79	5.00
183	002363	隆基机械	16,925,627.02	4.85
184	002385	大北农	16,592,605.24	4.75
185	300104	乐视网	16,554,655.00	4.74
186	600323	瀚蓝环境	16,342,474.20	4.68
187	600063	皖维高新	16,045,731.05	4.60
188	601118	海南橡胶	16,045,123.97	4.60
189	000538	云南白药	15,854,044.00	4.54
190	002661	克明面业	15,786,313.00	4.52
191	600196	复星医药	15,756,760.30	4.51
192	300306	远方光电	15,536,296.84	4.45
193	002097	山河智能	15,508,222.00	4.44
194	002572	索菲亚	15,395,191.32	4.41
195	300058	蓝色光标	15,341,815.56	4.40
196	300390	天华超净	15,210,158.60	4.36
197	600057	象屿股份	15,065,213.71	4.32
198	300133	华策影视	14,907,883.45	4.27
199	002076	雪 莱 特	14,881,275.47	4.26
200	002518	科士达	14,831,724.40	4.25
201	000608	阳光股份	14,730,713.31	4.22
202	002402	和而泰	14,617,548.16	4.19
203	300378	鼎捷软件	14,613,044.56	4.19
204	002538	司尔特	14,517,380.00	4.16
205	002325	洪涛股份	14,481,053.94	4.15
206	300286	安科瑞	14,467,306.74	4.15
207	000601	韶能股份	14,289,753.49	4.09
208	601669	中国电建	14,054,400.00	4.03
209	300299	富春通信	13,931,743.72	3.99
210	300395	菲利华	13,925,724.11	3.99
211	601198	东兴证券	13,873,131.62	3.97
212	000783	长江证券	13,842,128.00	3.97
213	600129	太极集团	13,798,831.60	3.95
214	300359	全通教育	13,798,178.39	3.95
215	600687	刚泰控股	13,669,457.09	3.92
216	002365	永安药业	13,624,743.10	3.90
217	600647	同达创业	13,557,347.96	3.88
218	002475	立讯精密	13,493,819.00	3.87
219	300242	明家科技	13,456,526.00	3.86
220	000722	湖南发展	13,346,262.00	3.82
221	300210	森远股份	13,341,940.24	3.82
222	600703	三安光电	13,089,190.47	3.75
223	000411	英特集团	13,061,809.00	3.74
224	002288	超华科技	12,867,886.19	3.69
225	002681	奋达科技	12,823,571.46	3.67
226	300206	理邦仪器	12,822,214.42	3.67
227	002666	德联集团	12,707,071.62	3.64
228	002531	天顺风能	12,350,208.00	3.54
229	300063	天龙集团	12,133,333.35	3.48
230	600850	华东电脑	11,994,202.70	3.44
231	600958	东方证券	11,740,019.00	3.36
232	002587	奥拓电子	11,663,570.96	3.34
233	002454	松芝股份	11,174,133.53	3.20
234	002244	滨江集团	10,906,075.39	3.12
235	002627	宜昌交运	10,391,784.05	2.98
236	002172	澳洋科技	10,332,481.94	2.96
237	603118	共进股份	9,975,369.41	2.86
238	002065	东华软件	9,423,446.00	2.70
239	300009	安科生物	9,406,870.93	2.70
240	002519	银河电子	9,215,176.40	2.64
241	000971	高升控股	9,042,454.00	2.59
242	000024	招商地产	8,929,164.00	2.56
243	600015	华夏银行	8,870,900.23	2.54
244	002139	拓邦股份	8,828,718.76	2.53
245	300065	海兰信	8,759,354.00	2.51
246	600525	长园集团	8,584,901.72	2.46
247	600438	通威股份	8,498,272.50	2.43
248	300369	绿盟科技	8,464,701.58	2.43
249	002391	长青股份	8,385,806.00	2.40
250	000678	襄阳轴承	8,365,409.19	2.40
251	601888	中国国旅	8,262,830.01	2.37
252	600987	航民股份	8,174,755.42	2.34
253	000952	广济药业	8,170,480.46	2.34
254	600885	宏发股份	8,103,578.90	2.32
255	600108	亚盛集团	8,043,909.50	2.30
256	600856	中天能源	8,034,362.00	2.30
257	002089	新 海 宜	7,966,876.14	2.28
258	002709	天赐材料	7,910,701.03	2.27
259	600831	广电网络	7,897,730.00	2.26
260	601098	中南传媒	7,780,081.62	2.23
261	300168	万达信息	7,649,640.28	2.19
262	300248	新开普	7,563,876.00	2.17
263	600172	黄河旋风	7,422,148.92	2.13
264	600290	华仪电气	7,371,068.36	2.11
265	600705	中航资本	7,135,709.00	2.04
266	600240	华业资本	7,120,757.06	2.04
267	600038	中直股份	7,114,381.70	2.04
268	300062	中能电气	7,015,391.68	2.01
269	600426	华鲁恒升	7,008,225.00	2.01
270	000915	山大华特	7,006,000.00	2.01

注:本项及下项8.4.2、8.4.3的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，"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。

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	600446	金证股份	187,586,706.01	53.75
2	600682	南京新百	185,399,524.56	53.12
3	002462	嘉事堂	171,963,116.36	49.27
4	002657	中科金财	163,020,007.96	46.71
5	002195	二三四五	151,395,189.22	43.38
6	600570	恒生电子	145,579,540.44	41.71
7	300207	欣旺达	134,896,112.22	38.65
8	000039	中集集团	124,887,819.53	35.78
9	000948	南天信息	119,852,036.77	34.34
10	300226	上海钢联	110,275,398.52	31.60
11	300070	碧水源	108,995,432.99	31.23
12	000838	财信发展	108,956,250.99	31.22
13	600115	东方航空	107,010,231.32	30.66
14	002280	联络互动	106,304,492.76	30.46
15	300170	汉得信息	104,319,792.63	29.89
16	002022	科华生物	103,210,360.39	29.57
17	300244	迪安诊断	103,062,328.97	29.53
18	300290	荣科科技	99,144,368.21	28.41
19	002183	怡 亚 通	98,017,330.11	28.08
20	300253	卫宁健康	97,581,729.21	27.96
21	601318	中国平安	97,184,403.62	27.84
22	002020	京新药业	95,853,887.32	27.46
23	600029	南方航空	94,027,242.84	26.94
24	300086	康芝药业	93,850,827.82	26.89
25	300028	金亚科技	91,548,278.69	26.23
26	300380	安硕信息	89,580,923.27	25.67
27	000503	海虹控股	88,247,047.58	25.28
28	601818	光大银行	88,038,748.06	25.22
29	002153	石基信息	87,890,385.53	25.18
30	600763	通策医疗	87,158,039.62	24.97
31	300431	暴风科技	86,310,230.40	24.73
32	002573	清新环境	80,658,417.46	23.11
33	300085	银之杰	78,236,162.13	22.42
34	300130	新国都	75,652,472.78	21.68
35	600422	昆药集团	73,711,707.51	21.12
36	000590	*ST古汉	73,547,644.92	21.07
37	300013	新宁物流	70,778,175.11	20.28
38	603883	老百姓	69,755,420.71	19.99
39	601901	方正证券	69,731,270.92	19.98
40	603008	喜临门	67,906,938.79	19.46
41	000925	众合科技	67,138,720.00	19.24
42	002197	证通电子	64,644,237.04	18.52
43	300377	赢时胜	64,179,427.51	18.39
44	601021	春秋航空	62,984,920.17	18.06
45	300155	安居宝	62,918,626.82	18.03
46	002294	信立泰	62,483,950.40	17.90
47	601388	怡球资源	62,323,833.63	17.86
48	300295	三六五网	62,296,042.72	17.85
49	002236	大华股份	61,554,608.63	17.64
50	601939	建设银行	59,531,351.34	17.06
51	002074	国轩高科	59,023,143.62	16.91
52	300273	和佳股份	58,574,723.05	16.78
53	600048	保利地产	58,396,114.35	16.73
54	300368	汇金股份	56,834,236.55	16.28
55	600804	鹏博士	55,603,498.69	15.93
56	002084	海鸥卫浴	55,487,507.96	15.90
57	002556	辉隆股份	54,952,412.50	15.74
58	000785	武汉中商	54,455,901.78	15.60
59	600535	天士力	53,236,194.48	15.25
60	601688	华泰证券	52,581,761.94	15.07
61	601166	兴业银行	52,040,489.34	14.91
62	600728	佳都科技	48,954,813.41	14.03
63	000025	特 力A	48,352,029.33	13.85
64	002719	麦趣尔	46,196,962.16	13.24
65	300430	诚益通	45,645,981.36	13.08
66	000802	北京文化	44,463,049.15	12.74
67	300255	常山药业	44,432,877.41	12.73
68	601377	兴业证券	44,382,082.51	12.72
69	000908	景峰医药	43,554,505.16	12.48
70	002594	比亚迪	43,411,660.94	12.44
71	002315	焦点科技	43,283,614.38	12.40
72	300367	东方网力	42,459,777.26	12.17
73	600815	厦工股份	42,054,581.51	12.05
74	601988	中国银行	41,338,513.20	11.84
75	300203	聚光科技	40,991,344.47	11.74
76	600276	恒瑞医药	38,456,304.74	11.02
77	600112	天成控股	38,328,039.94	10.98
78	002256	彩虹精化	38,162,720.08	10.93
79	300113	顺网科技	37,755,895.10	10.82
80	600185	格力地产	37,427,109.20	10.72
81	600373	中文传媒	36,101,249.44	10.34
82	300033	同花顺	35,966,894.27	10.30
83	600594	益佰制药	35,935,597.57	10.30
84	600630	交大昂立	35,346,244.04	10.13
85	600016	民生银行	34,797,320.45	9.97
86	300419	浩丰科技	33,742,941.90	9.67
87	600999	招商证券	33,727,952.41	9.66
88	300059	东方财富	32,874,176.54	9.42
89	600571	信雅达	32,315,708.27	9.26
90	600633	浙报传媒	31,818,454.03	9.12
91	002522	浙江众成	31,487,998.12	9.02
92	300146	汤臣倍健	31,217,851.20	8.94
93	300136	信维通信	30,999,341.01	8.88
94	000599	青岛双星	30,550,266.62	8.75
95	300291	华录百纳	30,249,350.06	8.67
96	600963	岳阳林纸	30,188,690.90	8.65
97	000400	许继电气	30,122,312.80	8.63
98	002177	御银股份	30,028,484.38	8.60
99	000593	大通燃气	29,786,096.98	8.53
100	000793	华闻传媒	29,123,710.55	8.34
101	000601	韶能股份	28,997,191.14	8.31
102	601328	交通银行	28,907,212.25	8.28
103	002455	百川股份	28,868,867.14	8.27
104	300010	立思辰	28,813,324.25	8.26
105	300011	鼎汉技术	27,975,306.23	8.02
106	000829	天音控股	27,914,768.22	8.00
107	000686	东北证券	27,817,616.14	7.97
108	300147	香雪制药	26,866,422.82	7.70
109	600598	北大荒	26,748,152.82	7.66
110	601628	中国人寿	26,727,663.72	7.66
111	600496	精工钢构	26,698,482.80	7.65
112	300039	上海凯宝	26,498,483.83	7.59
113	000768	中航飞机	26,386,447.24	7.56
114	002751	易尚展示	26,021,313.79	7.46
115	002208	合肥城建	25,769,950.59	7.38
116	002251	步 步 高	25,760,390.24	7.38
117	600366	宁波韵升	25,659,311.83	7.35
118	002016	世荣兆业	25,425,549.00	7.28
119	002510	天汽模	25,385,970.47	7.27
120	000721	西安饮食	25,096,010.91	7.19
121	002741	光华科技	25,077,185.50	7.18
122	600654	中安消	24,828,386.20	7.11
123	300017	网宿科技	24,786,294.15	7.10
124	000801	四川九洲	24,588,742.67	7.04
125	002620	瑞和股份	24,573,165.49	7.04
126	002312	三泰控股	24,121,147.35	6.91
127	002055	得润电子	23,691,987.00	6.79
128	300166	东方国信	23,618,085.48	6.77
129	300359	全通教育	23,558,426.46	6.75
130	300090	盛运环保	23,375,589.00	6.70
131	300037	新宙邦	23,143,027.71	6.63
132	300350	华鹏飞	22,892,598.17	6.56
133	002303	美盈森	22,813,799.60	6.54
134	002310	东方园林	22,471,396.56	6.44
135	000021	深科技	22,396,659.00	6.42
136	002400	省广股份	22,321,378.05	6.40
137	002282	博深工具	22,031,033.70	6.31
138	300231	银信科技	22,015,476.80	6.31
139	002482	广田股份	21,524,935.41	6.17
140	000150	宜华健康	21,231,552.70	6.08
141	002354	天神娱乐	21,116,645.33	6.05
142	002169	智光电气	20,789,655.18	5.96
143	600146	商赢环球	20,620,987.90	5.91
144	002616	长青集团	20,539,046.61	5.88
145	300104	乐视网	20,279,245.30	5.81
146	603128	华贸物流	19,541,075.54	5.60
147	300022	吉峰农机	19,315,670.80	5.53
148	300248	新开普	19,097,500.49	5.47
149	300026	红日药业	19,016,124.78	5.45
150	300058	蓝色光标	18,934,463.96	5.42
151	002038	双鹭药业	18,731,874.85	5.37
152	002397	梦洁家纺	18,693,596.99	5.36
153	002659	中泰桥梁	18,624,935.32	5.34
154	002271	东方雨虹	18,569,147.44	5.32
155	300262	巴安水务	18,545,283.67	5.31
156	600104	上汽集团	18,360,306.85	5.26
157	600536	中国软件	18,317,031.30	5.25
158	600030	中信证券	18,262,458.76	5.23
159	600063	皖维高新	18,168,403.80	5.21
160	601118	海南橡胶	18,127,507.76	5.19
161	002385	大北农	17,969,517.04	5.15
162	300018	中元华电	17,921,105.69	5.13
163	002276	万马股份	17,874,811.30	5.12
164	002538	司尔特	17,861,618.20	5.12
165	600587	新华医疗	17,752,406.60	5.09
166	000423	东阿阿胶	17,705,084.00	5.07
167	000411	英特集团	17,566,200.09	5.03
168	300298	三诺生物	17,188,098.46	4.92
169	300342	天银机电	17,141,361.34	4.91
170	002518	科士达	16,963,435.54	4.86
171	601886	江河创建	16,951,464.25	4.86
172	002572	索菲亚	16,781,564.32	4.81
173	002666	德联集团	16,436,048.99	4.71
174	300335	迪森股份	16,436,047.68	4.71
175	600958	东方证券	16,159,226.40	4.63
176	300415	伊之密	15,814,005.46	4.53
177	300348	长亮科技	15,755,928.00	4.51
178	300395	菲利华	15,733,795.64	4.51
179	000722	湖南发展	15,667,064.31	4.49
180	000858	五 粮 液	15,552,216.00	4.46
181	600703	三安光电	15,487,085.83	4.44
182	002402	和而泰	15,420,310.80	4.42
183	002288	超华科技	15,341,691.26	4.40
184	600057	象屿股份	15,252,836.75	4.37
185	300133	华策影视	15,245,463.43	4.37
186	000538	云南白药	15,128,711.75	4.33
187	300286	安科瑞	15,114,202.68	4.33
188	300306	远方光电	14,649,641.93	4.20
189	002661	克明面业	14,629,011.00	4.19
190	300378	鼎捷软件	14,583,314.51	4.18
191	601198	东兴证券	14,536,001.22	4.16
192	600196	复星医药	14,166,275.35	4.06
193	601669	中国电建	14,148,967.62	4.05
194	300206	理邦仪器	14,137,148.89	4.05
195	000783	长江证券	13,796,137.12	3.95
196	600687	刚泰控股	13,751,742.40	3.94
197	002047	宝鹰股份	13,649,764.00	3.91
198	600893	中航动力	13,537,131.00	3.88
199	600323	瀚蓝环境	13,316,313.66	3.82
200	002681	奋达科技	13,291,397.05	3.81
201	002076	雪 莱 特	13,242,032.50	3.79
202	002773	康弘药业	13,130,477.82	3.76
203	002531	天顺风能	12,832,941.03	3.68
204	600129	太极集团	12,744,176.55	3.65
205	600801	华新水泥	12,634,248.56	3.62
206	002184	海得控制	12,469,310.54	3.57
207	002454	松芝股份	12,397,853.09	3.55
208	600850	华东电脑	12,373,217.05	3.55
209	000608	阳光股份	12,161,114.85	3.48
210	300009	安科生物	11,922,888.52	3.42
211	300210	森远股份	11,779,137.24	3.37
212	002065	东华软件	11,695,726.00	3.35
213	600647	同达创业	11,545,161.07	3.31
214	600694	大商股份	11,173,463.46	3.20
215	603118	共进股份	11,065,027.30	3.17
216	000678	襄阳轴承	10,927,373.48	3.13
217	600986	科达股份	10,853,894.98	3.11
218	600222	太龙药业	10,762,997.39	3.08
219	002363	隆基机械	10,722,831.20	3.07
220	002587	奥拓电子	10,433,330.20	2.99
221	002131	利欧股份	10,304,936.00	2.95
222	002593	日上集团	10,226,297.60	2.93
223	002425	凯撒股份	10,033,387.72	2.87
224	300369	绿盟科技	9,961,225.17	2.85
225	000024	招商地产	9,712,877.00	2.78
226	002139	拓邦股份	9,687,441.91	2.78
227	002244	滨江集团	9,620,964.64	2.76
228	600885	宏发股份	9,532,086.25	2.73
229	002639	雪人股份	9,474,017.88	2.71
230	600831	广电网络	9,455,703.68	2.71
231	000672	上峰水泥	9,393,717.86	2.69
232	000671	阳 光 城	9,220,138.32	2.64
233	600525	长园集团	9,066,302.30	2.60
234	601888	中国国旅	9,042,866.80	2.59
235	600711	盛屯矿业	9,017,011.33	2.58
236	002653	海思科	8,965,120.86	2.57
237	300097	智云股份	8,901,712.32	2.55
238	000952	广济药业	8,818,985.20	2.53
239	002365	永安药业	8,808,820.80	2.52
240	600438	通威股份	8,707,207.37	2.49
241	300065	海兰信	8,663,677.00	2.48
242	600015	华夏银行	8,648,904.40	2.48
243	002714	牧原股份	8,383,751.13	2.40
244	002159	三特索道	8,365,603.60	2.40
245	002709	天赐材料	8,347,162.61	2.39
246	600705	中航资本	8,335,799.84	2.39
247	600172	黄河旋风	8,257,322.88	2.37
248	600987	航民股份	8,236,641.64	2.36
249	300168	万达信息	8,173,170.20	2.34
250	002172	澳洋科技	8,119,387.68	2.33
251	002391	长青股份	8,104,732.00	2.32
252	300005	探 路 者	7,996,727.00	2.29
253	600426	华鲁恒升	7,912,170.87	2.27
254	300062	中能电气	7,740,172.01	2.22
255	000915	山大华特	7,720,374.00	2.21
256	300183	东软载波	7,667,091.81	2.17
257	600290	华仪电气	7,530,680.00	2.16
258	300063	天龙集团	7,499,468.53	2.15
259	600240	华业资本	7,259,256.98	2.08
260	600108	亚盛集团	7,251,969.96	2.08
261	002631	德尔未来	7,171,934.70	2.05

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

买入股票的成本(成交)总额	10,647,670,614.13
卖出股票的收入(成交)总额	9,767,617,129.55

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3 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	1,514,295.21
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	28,115.29
5	应收申购款	1,979,949.15
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,522,359.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
41,302	21,476.73	151,396,352.74	17.07%	735,635,703.15	82.93%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	934,238.76	0.1053%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2013年5月28日)基金份额总额	4,034,601,387.29
本报告期期初基金份额总额	345,207,022.72
本报告期基金总申购份额	3,503,428,816.50
减:本报告期基金总赎回份额	2,961,603,783.33
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	887,032,055.89

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2015年4月30日，包林生不再担任本基金管理人的副总经理。2015年5月23日，肖雯不再担任本基金管理人的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
安信证券	5	1,277,800,646.61	6.26%	922,074.64	5.22%	–
北京高华	1	–	–	–	–	–
渤海证券	1	–	–	–	–	–
财富里昂	1	–	–	–	–	–
财富证券	2	–	–	–	–	–
川财证券	2	–	–	–	–	–
德邦证券	1	660,400,104.47	3.24%	601,227.31	3.41%	–
第一创业证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	2	1,132,034,565.88	5.55%	1,032,572.84	5.85%	–
东方证券	2	266,878,968.23	1.31%	242,967.08	1.38%	–
东莞证券	1	56,905,453.22	0.28%	51,806.31	0.29%	–
东海证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	2	–	–	–	–	新增1个
东兴证券	2	–	–	–	–	–
方正证券	6	1,159,141,920.24	5.68%	827,420.99	4.69%	新增2个
光大证券	3	717,484,583.66	3.52%	653,197.35	3.70%	–
广发证券	7	7,777,157.20	0.04%	7,242.94	0.04%	–
广州证券	2	382,344,290.60	1.87%	271,614.73	1.54%	–
国都证券	1	–	–	–	–	–
国海证券	1	1,003,104,380.06	4.91%	933,308.24	5.29%	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
国联证券	1	–	–	–	–	–
国盛证券	1	–	–	–	–	–
国泰君安	4	1,964,280,495.73	9.62%	1,789,963.89	10.14%	–
国信证券	4	1,503,818,826.97	7.37%	1,398,189.86	7.92%	–
国元证券	2	–	–	–	–	–
海通证券	2	153,395,051.49	0.75%	139,651.44	0.79%	–
宏源证券	3	47,654,464.87	0.23%	33,853.82	0.19%	–
华安证券	1	–	–	–	–	–
华宝证券	1	–	–	–	–	–
华创证券	3	712,362,109.49	3.49%	648,536.15	3.67%	新增2个
华福证券	2	–	–	–	–	–
华融证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	6	533,002,268.15	2.61%	485,246.27	2.75%	新增2个
华鑫证券	2	–	–	–	–	–
江海证券	1	–	–	–	–	–
联讯证券	2	1,087,635,215.80	5.33%	990,440.26	5.61%	–
民生证券	2	250,791,801.01	1.23%	178,162.27	1.01%	–
民族证券	1	–	–	–	–	–
南京证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	4	798,581,436.03	3.91%	567,311.99	3.21%	–
中泰证券	2	–	–	–	–	减少1个
瑞银证券	1	365,759,502.36	1.79%	332,986.61	1.89%	减少1个
长城国瑞证券	0	–	–	–	–	–
上海证券	1	–	–	–	–	–
申银万国	3	349,700,508.54	1.71%	318,368.47	1.80%	–
世纪证券	1	–	–	–	–	–
首创证券	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	2	–	–	–	–	–
天风证券	1	–	–	–	–	新增1个
万联证券	4	–	–	–	–	新增2个
西部证券	1	55,792,264.77	0.27%	50,793.20	0.29%	–
西南证券	2	9,473,710.55	0.05%	8,624.87	0.05%	新增1个
湘财证券	1	–	–	–	–	–
新时代证券	1	353,169,850.06	1.73%	328,015.01	1.86%	–
信达证券	2	234,938,027.57	1.15%	166,900.65	0.95%	–
兴业证券	4	526,665,515.66	2.58%	480,737.16	2.72%	–
银河证券	3	–	–	–	–	–
英大证券	2	175,410,684.40	0.86%	124,611.95	0.71%	–
长城证券	1	–	–	–	–	–
长江证券	3	1,347,875,713.68	6.60%	1,228,909.13	6.96%	–
招商证券	3	172,381,426.91	0.84%	160,539.44	0.91%	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
中金公司	2	85,645,191.44	0.42%	79,761.22	0.45%	–
中天证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	3	426,549,678.81	2.09%	390,440.68	2.21%	–
中信建投	4	991,930,781.91	4.86%	903,054.15	5.12%	–
中信证券	4	787,226,806.64	3.86%	717,200.69	4.06%	新增1个
中信证券(浙江)	0	–	–	–	–	减少1个
中银国际	2	813,204,940.67	3.98%	583,916.68	3.31%	–
中原证券	2	–	–	–	–	–

注:1、交易席位选择标准:

(1)财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

(2)经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

(3)具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

(4)具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5)能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6)能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程:

(1)对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2)协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

广发基金管理有限公司
二〇一六年三月二十八日