（上接B051版）

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
基金赎回费收入	1,579.97	6,413.43
其他	5,392.40	-
转换费收入	0.63	69.84
印花税返还	-	2,694.25
合计	6,973.00	9,177.52

7.4.7.20交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
交易所市场交易费用	829,354.28	4,570,255.35
银行间市场交易费用	350.00	900.00
合计	829,704.28	4,571,155.35

7.4.7.21其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	310,000.00	330,000.00
其他费用	700.00	200.00
账户维护费	31,500.00	36,000.00
银行汇划费用	720.00	6,350.29
转托管费	-	300.00
合计	412,920.00	442,850.29

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除7.4.6.2营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海泉意金融信息服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	基金管理人的子公司

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	190,428,133.47	6.40%

7.4.10.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	82,181,353.65	52.82%

7.4.10.1.4债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
金元证券股份有限公司	-	-	8,000,000.00	0.48%

7.4.10.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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
金元证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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
金元证券股份有限公司	173,364.28	6.43%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,807,888.97	3,229,294.74
其中：支付销售机构的客户维护费	440,157.70	784,208.23

注：

1、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为每日应支付的基金管理费，

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。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日 至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日 至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	301,314.69	538,215.79

注：

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为每日应支付的基金托管费，

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。

7.4.10.3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可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券（含回购）交易。

7.4.10.4各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2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

本基金本报告期末及上年度末均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,336,783.81	83,730.70	20,777,497.69	92,926.17

注：本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2016年度获得的利息收入为人民币5,346.77元（2015年度获得的利息收入为人民币32,464.67元），2016年末结算备付金余额为人民币275,996.15元（2015年末结算备付金余额为人民币404,042.08元）。

7.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601375	中原证券	2016-12-21	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	1,000	4,000.00	4,000.00	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股未上市	21.30	21.30	1,463	31,161.90	31,161.90	-

7.4.12.2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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002795	永和智控	2016-12-02	重大资产重组	91.60	2017-03-22	82.44	725	10,766.25	66,410.00	-
002798	帝王洁具	2016-11-02	重大资产重组	67.00	2017-01-17	60.34	812	8,582.84	54,404.00	-
300513	恒泰实达	2016-10-31	重大资产重组	95.36	2017-02-24	86.18	500	5,865.00	47,680.00	-

7.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.13金融工具风险及管理

7.4.13.1风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

7.4.13.2信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以降低信用风险。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年末 2015年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	9,987,000.00	20,495,170.00
合计	9,987,000.00	20,495,170.00

注：未评级债券为国债。

7.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年12月31日	上年末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	17,437,072.10	22,720,337.50
未评级	21,159,050.00	21,899,150.00
合计	38,596,122.10	44,619,487.50

注：未评级债券为国债和政策性金融债。

7.4.13.3流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易；因此，除在附注7.4.12中列示的本基金期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.4市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及应收申购款等。

7.4.13.4.1.1利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,336,783.81	-	-	-	1,336,783.81
结算备付金	275,996.15	-	-	-	275,996.15
存出保证金	26,820.35	-	-	-	26,820.35
交易性金融资产	22,947,405.43	15,460,716.67	10,175,000.00	59,514,608.94	108,097,731.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,636,085.63	1,636,085.63
应收申购款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,587,005.74	15,460,716.67	10,175,000.00	61,150,694.57	111,373,416.98
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.74	0.74
应付管理人报酬	-	-	-	141,618.02	141,618.02
应付托管费	-	-	-	23,603.02	23,603.02
应付交易费用	-	-	-	514,394.68	514,394.68
应付销售服务费	-	-	-	-	0.00
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	0.00
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00
其他负债	-	-	-	-	0.00
应交税金	-	-	-	-	0.00
预提费用	-	-	-	70,000.00	70,000.00
应付赎回款	-	-	-	32,465.92	32,465.92
负债总计	-	-	-	782,082.38	782,082.38
利率敏感度缺口	24,587,005.74	15,460,716.67	10,175,000.00	60,368,612.19	110,591,334.60
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,777,497.69	-	-	-	20,777,497.69
结算备付金	404,042.08	-	-	-	404,042.08
存出保证金	220,608.99	-	-	-	220,608.99
交易性金融资产	22,813,420.00	31,843,237.50	10,458,000.00	62,472,745.98	127,587,403.48
衍生金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,291,859.01	1,291,859.01
应收利息	-	-	-	2,004,969.71	2,004,969.71
应收申购款	988.14	-	-	-	988.14
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	44,216,556.90	31,843,237.50	10,458,000.00	65,769,574.70	152,287,369.10
负债					
应付赎回费	-	-	-	0.77	0.77
应付管理人报酬	-	-	-	191,134.80	191,134.80
应付托管费	-	-	-	31,855.81	31,855.81
应付交易费用	-	-	-	685,291.81	685,291.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
应交税金	-	-	-	-	-
预提费用	-	-	-	70,000.00	70,000.00
应付赎回款	-	-	-	130,059.59	130,059.59
负债总计	-	-	-	1,108,342.78	1,108,342.78
利率敏感度缺口	44,216,556.90	31,843,237.50	10,458,000.00	64,661,231.92	151,179,026.32

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。7.4.13.4.1.2利率风险的敏感性分析

假设	以中央国债登记结算有限责任公司公布的2016年12月31日和2015年12月31日各债券的基点价值（BP价值）为主要计算依据；		
	假设债券持仓结构保持不变；		
	银行存款、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率下降1BP	增加1.08万元	增加1.51万元
	市场利率上升1BP	减少1.07万元	减少1.51万元

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	59,514,608.94	53.81	62,472,745.98	41.32
交易性金融资产-债券投资	48,583,122.10	43.93	65,114,657.50	43.07
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	108,097,731.04	97.75	127,587,403.48	84.39

注：本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为40%-60%，债券资产占基金资产的比例为35%-55%，权证不超过基金资产净值的3%，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%。

7.4.13.4.3.2其他价格风险的敏感性分析

假设	本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关。		
	以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	标普中国300指数上涨5%	增加351.83万元	增加300.13万元
	标普中国300指数下跌5%	减少351.83万元	减少300.13万元

注：本基金管理人运用资本一资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.13.4.4采用风险价值法管理风险

风险价值（VaR）含义是指：在市场正常波动下，某一金融资产或证券组合的最大可能损失。更为确切的是指，在一定概率水平（置信度）下，某一金融资产或证券组合价值在未来特定时期内的最大可能损失。用公式表示为：Prob（ΔP>VaR）=1?α或Prob（ΔP<VaR）=α，

其中Prob表示：资产价值损失小于可能损失上限的概率。ΔP表示：某一金融资产在一定持有期Δt的价值损失额。VAR表示：给定置信水平α下的在险价值，即可能的损失上限。α为：给定的置信水平。

假设	在99%的置信水平下采用风险价值模型来管理风险；		
	以资产负债表日前125个交易日为观察期；		
	预测期间本基金的资产组合的结构保持不变；		
	本基金的基金净值日对数收益率服从正态分布。		
分析	风险价值	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	合计	增加148.23万元	增加543.75万元

注：上述分析衡量了在99%的置信水平下，所持有的资产组合在资产负债表日后一个交易日内由于市场价格风险所导致的最大潜在损失。

7.4.14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

7.4.14.1.1不以公允价值计量的金融工具

银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币59,310,953.04元，属于第二层次的余额为人民币48,786,778.00元，无属于第三层次的余额。（于2015年12月31日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币54,056,370.98元，属于第二层次的余额为人民币73,531,032.50元，无属于第三层次的余额。）

7.4.14.1.2.2公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

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。

§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	59,514,608.94	53.44
	其中：股票	59,514,608.94	53.44
2	固定收益投资	48,583,122.10	43.62
	其中：债券	48,583,122.10	43.62
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	买入返售金融资产	-	-
5	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	1,612,779.96	1.45
7	其他各项资产	1,662,905.98	1.49
8	合计	111,373,416.98	100.00

8.2 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	6,119,124.78	5.53
B	采矿业	81,024.24	0.07
C	制造业	15,830,139.27	14.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,802,413.93	17.00
F	批发和零售业	2,362,617.00	2.14
G	交通运输、仓储和邮政业	3,250,786.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,680.00	0.04
J	金融业	6,630,618.00	6.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,187,206.44	4.69
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	1,129,018.00	1.02
R	文化、体育和娱乐业	73,981.28	0.07
S	综合	-	-
	合计	59,514,608.94	53.81

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	20,464	6,838,045.60	6.18
2	600491	龙元建设	473,400	5,463,036.00	4.94
3	600502	安徽水利	539,109	5,380,307.82	4.87
4	300284	苏交科	247,302	5,143,881.60	4.65
5	600276	恒瑞医药	90,840	4,133,220.00	3.74
6	002299	圣农发展	186,115	3,949,360.30	3.57
7	600068	葛洲坝	390,200	3,585,938.00	3.24
8	600036	招商银行	186,400	3,280,640.00	2.97
9	601169	北京银行	333,600	3,255,936.00	2.94
10	600115	东方航空	459,800	3,250,786.00	2.94
11	000151	中成股份	116,700	2,286,153.00	2.07
12	002051	中工国际	94,700	2,170,524.00	1.96
13	601618	中国中冶	460,300	2,144,998.00	1.94
14	002234	民和股份	98,600	2,127,788.00	1.92
15	000568	泸州老窖	61,700	2,036,100.00	1.84
16	600345	长江通信	83,800	1,903,936.00	1.72
17	300347	泰格医药	41,800	1,129,018.00	1.02
18	300505	川金诺	1,624	116,245.92	0.11
19	601020	华钰矿业	2,068	81,024.24	0.07
20	002788	鹭燕医药	1,296	76,464.00	0.07
21	603528	多伦科技	1,167	76,263.45	0.07
22	603028	赛福天	2,592	68,558.40	0.06
23	300510	金冠电气	1,938	67,248.60	0.06
24	002795	永和智控	725	66,410.00	0.06
25	603919	金徽酒	1,902	59,095.14	0.05
26	300515	三德科技	1,147	58,818.16	0.05
27	002789	建艺集团	731	57,610.11	0.05
28	002798	帝王洁具	812	54,404.00	0.05
29	603131	上海沪工	926	54,189.52	0.05
30	603861	白云电器	1,620	51,159.60	0.05
31	601900	南方传媒	3,256	50,891.28	0.05
32	300513	恒泰实达	500	47,680.00	0.04
33	002797	第一创业	1,365	47,502.00	0.04
34	603737	三棵树	601	43,885.02	0.04
35	002799	环球印务	864	43,433.28	0.04
36	603959	百利科技	1,508	43,324.84	0.04
37	300511	雪榕生物	868	41,976.48	0.04
38	300516	久之洋	409	39,779.34	0.04
39	603339	四方冷链	916	34,148.48	0.03
40	300512	中亚股份	942	31,396.86	0.03
41	603877	太平鸟	1,463	31,161.90	0.03
42	601229	上海银行	1,000	23,280.00	0.02
43	600977	中国电影	1,000	23,090.00	0.02
44	002815	崇达技术	500	22,640.00	0.02
45	600919	江苏银行	2,000	19,260.00	0.02
46	601375	中原证券	1,000	4,000.00	0.00

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	600276	恒瑞医药	8,884,840.00	5.88
2	600519	贵州茅台	8,600,740.74	5.69
3	300284	苏交科	5,796,821.06	3.83
4	600491	龙元建设	5,774,021.43	3.82
5	600115	东方航空	5,722,536.00	3.79
6	002045	国光电器	5,532,049.00	3.66
7	600502	安徽水利	5,224,895.20	3.46
8	300065	海兰信	5,197,914.00	3.44
9	600391	成发科技	4,957,198.00	3.28
10	002234	民和股份	4,862,265.66	3.22
11	600718	东软集团	4,821,255.90	3.19
12	002299	圣农发展	4,812,344.50	3.18
13	300401	花园生物	4,806,241.00	3.18
14	601009	南京银行	4,788,164.32	3.17
15	000952	广济药业	4,782,234.60	3.16
16	600803	新奥股份	4,574,890.00	3.03
17	600521	华海药业	4,343,815.24	2.87
18	300188	美亚柏科	3,971,097.25	2.63
19	300070	碧水源	3,970,795.00	2.63
20	000333	美的集团	3,968,790.00	2.63
21	300146	汤臣倍健	3,966,027.41	2.62
22	002563	森马服饰	3,965,652.00	2.62
23	000651	格力电器	3,960,146.00	2.62
24	300113	顺网科技	3,911,256.12	2.59
25	600485	信威集团	3,872,067.90	2.56
26	002405	四维图新	3,835,337.00	2.54
27	002562	兄弟科技	3,616,263.45	2.39
28	600111	北方稀土	3,604,490.00	2.38
29	601939	建设银行	3,591,874.00	2.38
30	600015	华夏银行	3,590,706.00	2.38
31	601117	中国化学	3,589,643.00	2.37
32	600547	山东黄金	3,581,760.00	2.37
33	601788	光大证券	3,500,697.04	2.32
34	600068	葛洲坝	3,496,064.00	2.31
35	600208	新湖中宝	3,479,851.00	2.30
36	600036	招商银行	3,442,281.00	2.28
37	601169	北京银行	3,440,765.00	2.28
38	601377	兴业证券	3,421,295.10	2.26
39	002385	大北农	3,340,410.00	2.21
40	600562	国睿科技	3,307,445.10	2.19
41	002519	银河电子	3,242,100.01	2.14

注：本项的“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	300188	美亚柏科	7,484,183.00	4.95
2	600105	永鼎股份	5,486,825.59	3.63
3	600276	恒瑞医药	5,286,372.00	3.50
4	600391	成发科技	5,039,496.40	3.33
5	601009	南京银行	5,003,917.00	3.31
6	600547	山东黄金	4,687,120.00	3.10
7	300401	花园生物	4,669,391.00	3.09
8	000952	广济药业	4,589,821.40	3.04
9	600990	四创电子	4,521,384.00	2.99
10	600521	华海药业	4,493,616.65	2.97
11	002657	中科金财	4,406,099.48	2.91
12	600803	新奥股份	4,163,151.00	2.75
13	002045	国光电器	4,159,147.96	2.75
14	300065	海兰信	4,137,707.00	2.74
15	300113	顺网科技	3,973,676.40	2.63
16	600519	贵州茅台	3,903,857.14	2.58
17	000651	格力电器	3,896,610.00	2.58
18	300146	汤臣倍健	3,893,073.96	2.58
19	601788	光大证券	3,822,982.12	2.53
20	600718	东软集团	3,810,464.50	2.52
21	002562	兄弟科技	3,751,430.47	2.48
22	002343	慈文传媒	3,721,976.16	2.46
23	000333	美的集团	3,705,005.24	2.45
24	300070	碧水源	3,696,190.00	2.44
25	600111	北方稀土	3,646,590.00	2.41
26	601939	建设银行	3,562,790.00	2.36
27	002563	森马服饰	3,532,573.50	2.34
28	600015	华夏银行	3,521,940.00	2.33
29	601117	中国化学