(上接B113版)

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
000876	新希望	2015年8月17日	重大事项	17.61	2016年3月2日	17.09	1,551,900	30,403,624.00	27,328,959.00	指数法估值
300069	金利华电	2015年10月29日	重大事项	29.85	2016年2月16日	26.87	336,931	9,954,887.02	10,057,390.35	–
600690	青岛海尔	2015年10月19日	重大事项	9.92	2016年2月1日	8.93	398,753	3,708,704.51	3,955,629.76	–
000803	金宇车城	2015年12月24日	重大事项	30.12	2016年1月21日	27.11	107,013	2,877,143.28	3,223,231.56	–
002465	海格通信	2015年12月30日	重大事项	16.69	2016年2月4日	15.02	88,327	1,475,277.96	1,474,177.63	–
002164	宁波东力	2015年12月17日	重大事项	10.35	–	–	30,600	299,880.00	316,710.00	–
600603	大洲兴业	2015年9月11日	重大事项	18.60	2016年1月14日	13.55	10,358	158,939.80	192,658.80	指数法估值
600455	博通股份	2015年10月23日	重大事项	46.03	2016年2月23日	43.23	1,134	53,277.07	52,198.02	–
002082	栋梁新材	2015年9月18日	重大事项	10.21	2016年3月23日	11.23	1,552	24,538.80	15,845.92	–
601058	赛轮金宇	2015年12月28日	重大事项	9.00	2016年1月12日	8.10	43	359.85	387.00	–

注:本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票,该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法,并于2015年12月31日对资产净值和本期净利润的影响均为人民币-2,076,573.76元。

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

本基金本报告期末在银行间市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末在交易所市场未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.10.1公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应付证券清算款等,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1,444,725,552.93元,属于第二层次的余额为人民币678,825,788.04元,无属于第三层次的余额(2014年12月31日:第一层次人民币374,579,329.21元,第二层次人民币49,977,739.55元,无属于第三层次的余额)。

(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818,504.08元(2014年度:无),由第二层次转入第一层次的金额为人民币1,709,074.40元(2014年度:无)。

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<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>的通知》的规定,自2015年3月26日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

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(2014年度:无)。

7.4.10.2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。

7.4.10.3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	1,482,850,142.17	19.30
	其中:股票	1,482,850,142.17	19.30
2	固定收益投资	640,701,198.80	8.34
	其中:债券	640,701,198.80	8.34
	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	4,359,674,964.50	56.74
	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	926,566,736.94	12.06
7	其他各项资产	274,355,187.27	3.57
8	合计	7,684,148,229.68	100.00

注:由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	15,703,604.32	0.21
B	采矿业	14,229,885.56	0.19
C	制造业	576,169,042.20	7.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,488,128.15	0.11
E	建筑业	22,204,689.77	0.29
F	批发和零售业	3,885,343.24	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	29,581,861.72	0.39
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	261,185,241.95	3.43
J	金融业	365,063,411.45	4.80
K	房地产业	12,862,496.31	0.17
L	租赁和商务服务业	5,168,468.09	0.07
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
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	167,953,720.38	2.21
S	综合	244,856.82	0.00
	合计	1,482,850,142.17	19.49

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	600637	东方明珠	2,266,514	85,878,215.46	1.13
2	000793	华闻传媒	5,619,892	84,466,976.76	1.11
3	300471	厚普股份	935,656	69,799,937.60	0.92
4	300133	华策影视	2,314,254	68,941,626.66	0.91
5	002292	奥飞动漫	1,140,387	58,969,411.77	0.78
6	002410	广联达	3,007,987	54,685,203.66	0.72
7	600038	中直股份	925,165	48,783,950.45	0.64
8	300017	网宿科技	717,238	43,027,107.62	0.57
9	000651	格力电器	1,781,466	39,815,765.10	0.52
10	601166	兴业银行	2,228,683	38,043,618.81	0.50

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于公司网站的年度报告正文。

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	600536	中国软件	328,088,091.17	63.64
2	601318	中国平安	240,390,455.37	46.63
3	300059	东方财富	223,710,914.73	43.39
4	601166	兴业银行	204,411,664.01	39.65
5	000651	格力电器	200,094,370.54	38.81
6	000538	云南白药	199,842,410.70	38.76
7	600015	华夏银行	197,256,584.52	38.26
8	300285	国瓷材料	194,900,802.01	37.81
9	600085	同仁堂	164,775,648.49	31.96
10	300017	网宿科技	138,817,263.25	26.93
11	600036	招商银行	136,319,754.77	26.44
12	600030	中信证券	135,718,273.94	26.33
13	600016	民生银行	132,346,693.98	25.67
14	000895	双汇发展	120,937,795.45	23.46
15	601288	农业银行	120,083,300.81	23.29
16	600637	东方明珠	119,871,869.49	23.25
17	600038	中直股份	117,649,262.66	22.82
18	300133	华策影视	113,646,472.90	22.04
19	000001	平安银行	105,555,743.15	20.47
20	600597	光明乳业	105,415,133.21	20.45
21	000793	华闻传媒	103,591,725.29	20.09
22	600000	浦发银行	102,586,891.87	19.90
23	002475	立讯精密	97,849,920.98	18.98
24	002439	启明星辰	94,343,151.94	18.30
25	600518	康美药业	92,187,493.87	17.88
26	601211	国泰君安	89,757,901.17	17.41
27	002292	奥飞动漫	89,632,918.08	17.39
28	002410	广联达	88,032,569.84	17.08
29	601668	中国建筑	84,202,378.39	16.33
30	000977	浪潮信息	83,877,657.77	16.27
31	600837	海通证券	83,144,910.69	16.13
32	600705	中航资本	81,859,865.57	15.88
33	600519	贵州茅台	81,507,613.99	15.81
34	600887	伊利股份	81,463,514.66	15.80
35	002329	皇氏集团	80,846,096.61	15.68
36	600958	东方证券	79,749,092.56	15.47
37	601169	北京银行	79,686,030.43	15.46
38	000423	东阿阿胶	78,364,949.76	15.20
39	002230	科大讯飞	77,655,161.31	15.06
40	600179	黑化股份	74,120,080.92	14.38
41	002458	益生股份	73,765,694.86	14.31
42	000776	广发证券	71,836,937.94	13.93
43	601601	中国太保	71,070,049.25	13.79
44	600570	恒生电子	70,938,139.76	13.76
45	300443	金雷风电	68,262,320.18	13.24
46	601633	长城汽车	67,738,917.14	13.14
47	300458	全志科技	67,691,191.62	13.13
48	600050	中国联通	67,449,298.43	13.08
49	300395	菲利华	67,080,114.96	13.01
50	300251	光线传媒	66,731,761.03	12.94
51	000625	长安汽车	65,640,725.40	12.73
52	000568	泸州老窖	65,355,473.70	12.68
53	000750	国海证券	64,464,864.34	12.50
54	601766	中国中车	64,194,140.29	12.45
55	601009	南京银行	63,401,196.39	12.30
56	603022	新通联	62,697,878.12	12.16
57	002344	海宁皮城	61,247,006.55	11.88
58	000802	北京文化	61,163,016.76	11.86
59	601058	赛轮金宇	59,666,943.92	11.57
60	600309	万华化学	58,381,801.17	11.32
61	600048	保利地产	57,485,181.30	11.15
62	000002	万科A	57,157,893.80	11.09
63	601818	光大银行	56,344,344.56	10.93
64	002268	卫士通	56,333,459.26	10.93
65	300065	海兰信	55,940,792.52	10.85
66	600018	上港集团	55,031,926.78	10.67
67	600973	宝胜股份	54,214,865.17	10.52
68	600455	博通股份	53,347,802.79	10.35
69	600369	西南证券	53,293,011.95	10.34
70	600761	安徽合力	53,263,334.92	10.33
71	600037	歌华有线	52,816,418.08	10.24
72	002153	石基信息	51,758,085.43	10.04
73	002236	大华股份	51,496,559.89	9.99
74	601988	中国银行	50,045,055.53	9.71
75	300452	山河药辅	49,865,467.16	9.67
76	300369	绿盟科技	49,609,659.68	9.62
77	000592	平潭发展	48,542,656.00	9.42
78	300213	佳讯飞鸿	46,888,684.70	9.10
79	601628	中国人寿	46,431,220.76	9.01
80	600446	金证股份	46,177,953.57	8.96
81	600150	中国船舶	43,879,046.92	8.51
82	601186	中国铁建	43,487,676.15	8.44
83	002058	威尔泰	43,375,729.74	8.41
84	600999	招商证券	42,680,756.88	8.28
85	601390	中国中铁	42,490,344.91	8.24
86	000566	海南海药	42,366,041.43	8.22
87	600031	三一重工	42,114,125.15	8.17
88	002500	山西证券	42,002,050.07	8.15
89	002013	中航机电	41,413,265.80	8.03
90	300329	海伦钢琴	41,348,532.94	8.02
91	600690	青岛海尔	41,117,974.16	7.98
92	601901	方正证券	40,586,275.97	7.87
93	300462	华铭智能	40,501,117.75	7.86
94	300140	启源装备	40,437,809.90	7.84
95	601006	大秦铁路	39,756,634.32	7.71
96	600028	中国石化	39,677,357.50	7.70
97	601857	中国石油	39,004,708.26	7.57
98	600104	上汽集团	38,580,793.93	7.48
99	601939	建设银行	38,385,821.42	7.45
100	000333	美的集团	38,365,309.05	7.44
101	000915	山大华特	37,134,216.94	7.20
102	601688	华泰证券	36,804,411.11	7.14
103	300471	厚普股份	36,240,669.41	7.03
104	600893	中航动力	35,664,981.58	6.92
105	300037	新宙邦	35,211,667.89	6.83
106	002179	中航光电	35,087,744.97	6.81
107	600276	恒瑞医药	34,637,379.93	6.72
108	600590	泰豪科技	34,581,327.46	6.71
109	601336	新华保险	34,493,199.38	6.69
110	300302	同有科技	34,420,522.20	6.68
111	000876	新希望	34,364,302.34	6.67
112	000826	启迪桑德	33,791,965.20	6.55
113	300228	富瑞特装	33,760,141.11	6.55
114	601985	中国核电	33,659,020.17	6.53
115	601989	中国重工	33,198,536.40	6.44
116	600410	华胜天成	33,164,697.48	6.43
117	000157	中联重科	32,983,001.20	6.40
118	300457	赢合科技	32,828,245.90	6.37
119	600352	浙江龙盛	32,561,159.63	6.32
120	000605	渤海股份	32,517,803.18	6.31
121	300207	欣旺达	32,287,551.40	6.26
122	002142	宁波银行	32,233,008.61	6.25
123	600585	海螺水泥	31,675,224.70	6.14
124	000733	振华科技	31,411,175.38	6.09
125	600089	特变电工	31,041,394.14	6.02
126	002104	恒宝股份	30,559,501.35	5.93
127	601088	中国神华	30,536,675.22	5.92
128	600694	大商股份	29,912,940.42	5.80
129	002465	海格通信	29,581,151.30	5.74
130	600109	国金证券	28,404,349.63	5.51
131	601998	中信银行	28,391,507.49	5.51
132	002003	伟星股份	28,133,253.16	5.46
133	300398	飞凯材料	28,108,992.40	5.45
134	600184	光电股份	27,623,054.66	5.36
135	002501	利源精制	27,592,389.93	5.35
136	600749	西藏旅游	27,556,921.88	5.35
137	603883	老百姓	27,079,096.45	5.25
138	600768	宁波富邦	26,271,876.76	5.10
139	300447	全信股份	25,895,010.76	5.02
140	000725	京东方A	25,320,752.00	4.91
141	000858	五粮液	24,947,106.61	4.84
142	002676	顺威股份	24,880,361.36	4.83
143	300379	东方通	24,659,399.00	4.78
144	002294	信立泰	23,632,739.05	4.58
145	300440	运达科技	23,629,621.28	4.58
146	600372	中航电子	23,492,383.31	4.56
147	002053	云南盐化	23,414,696.02	4.54
148	603601	再升科技	23,143,356.58	4.49
149	300252	金信诺	22,724,239.62	4.41
150	300450	先导智能	22,679,093.69	4.40
151	601618	中国中冶	22,487,030.00	4.36
152	600774	汉商集团	22,059,831.08	4.28
153	601098	中南传媒	21,869,321.96	4.24
154	600011	华能国际	21,688,044.73	4.21
155	000785	武汉中商	21,395,648.78	4.15
156	600029	南方航空	20,982,083.90	4.07
157	600019	宝钢股份	20,956,379.89	4.06
158	601800	中国交建	20,886,897.72	4.05
159	600383	金地集团	20,056,899.03	3.89
160	300486	东杰智能	19,984,242.46	3.88
161	000166	申万宏源	19,908,162.15	3.86
162	000338	潍柴动力	19,574,075.86	3.80
163	600280	中央商场	19,304,778.63	3.74
164	000728	国元证券	18,684,387.18	3.62
165	000917	电广传媒	18,531,232.15	3.59
166	600010	包钢股份	18,497,913.00	3.59
167	300161	华中数控	18,276,642.60	3.55
168	601377	兴业证券	17,986,676.52	3.49
169	300428	四通新材	17,878,279.14	3.47
170	002241	歌尔声学	17,815,839.96	3.46
171	002634	棒杰股份	17,544,409.14	3.40
172	600900	长江电力	17,375,471.37	3.37
173	600315	上海家化	17,257,827.32	3.35
174	000783	长江证券	17,247,478.44	3.35
175	600066	宇通客车	17,060,116.10	3.31
176	000402	金融街	17,013,167.00	3.30
177	600765	中航重机	16,906,665.33	3.28
178	600703	三安光电	16,874,364.98	3.27
179	002024	苏宁云商	16,837,578.18	3.27
180	002202	金风科技	16,811,544.00	3.26
181	002205	国统股份	16,727,634.80	3.24
182	000801	四川九洲	16,624,729.90	3.22
183	600648	外高桥	16,623,040.69	3.22
184	600115	东方航空	16,385,424.84	3.18
185	002185	华天科技	16,133,749.98	3.13
186	600535	天士力	16,122,763.59	3.13
187	600741	华域汽车	15,988,715.23	3.10
188	000063	中兴通讯	15,911,954.10	3.09
189	000623	吉林敖东	15,895,474.31	3.08
190	300377	赢时胜	15,806,246.19	3.07
191	600717	天津港	15,520,081.73	3.01
192	600674	川投能源	15,498,322.06	3.01
193	600583	海油工程	15,454,319.79	3.00
194	000413	东旭光电	15,356,928.42	2.98
195	601111	中国国航	15,095,729.82	2.93
196	603818	曲美家居	15,041,564.24	2.92
197	300024	机器人	15,023,013.50	2.91
198	000792	盐湖股份	14,852,132.10	2.88
199	002234	民和股份	14,659,354.00	2.84
200	601899	紫金矿业	14,652,065.70	2.84
201	600177	雅戈尔	14,529,487.29	2.82
202	002450	康得新	14,448,514.87	2.80
203	300274	阳光电源	14,382,036.04	2.79
204	000686	东北证券	14,347,676.71	2.78
205	600111	北方稀土	14,089,965.95	2.73
206	600340	华夏幸福	14,033,407.38	2.72
207	000009	中国宝安	14,006,983.81	2.72
208	002169	智光电气	13,956,309.00	2.71
209	000156	华数传媒	13,924,758.79	2.70
210	300444	双杰电气	13,885,918.22	2.69
211	600588	用友网络	13,884,518.90	2.69
212	000014	沙河股份	13,617,047.59	2.64
213	300429	强力新材	13,592,624.16	2.64
214	300101	振芯科技	13,570,455.00	2.63
215	600068	葛洲坝	13,527,847.63	2.62
216	300353	东土科技	13,480,337.53	2.61
217	600385	山东金泰	13,448,430.79	2.61
218	002664	信质电机	13,408,900.00	2.60
219	600196	复星医药	13,401,253.20	2.60
220	600221	海南航空	13,341,501.00	2.59
221	600867	通化东宝	13,260,657.33	2.57
222	601607	上海医药	13,217,984.32	2.56
223	600415	小商品城	13,187,132.91	2.56
224	002304	洋河股份	13,103,940.46	2.54
225	600271	航天信息	12,994,545.46	2.52
226	000069	华侨城A	12,945,643.94	2.51
227	300016	北陆药业	12,810,117.64	2.48
228	002081	金螳螂	12,761,110.42	2.48
229	600118	中国卫星	12,747,273.76	2.47
230	601669	中国电建	12,640,983.79	2.45
231	600079	人福医药	12,511,494.50	2.43
232	002002	鸿达兴业	12,436,389.95	2.41
233	600886	国投电力	12,330,460.57	2.39
234	600600	青岛啤酒	12,329,450.69	2.39
235	600009	上海机场	12,321,267.34	2.39
236	600578	京能电力	12,173,109.57	2.36
237	600423	柳化股份	11,711,168.79	2.27
238	000539	粤电力A	11,616,518.69	2.25
239	300069	金利华电	11,611,489.00	2.25
240	601117	中国化学	11,529,801.40	2.24
241	002456	欧菲光	11,503,943.00	2.23
242	300003	乐普医疗	11,485,392.35	2.23
243	603030	全筑股份	11,276,275.50	2.19
244	000039	中集集团	11,258,910.57	2.18
245	600166	福田汽车	11,025,466.16	2.14
246	600391	成发科技	10,830,041.00	2.10
247	002352	鼎泰新材	10,820,446.08	2.10
248	002400	省广股份	10,787,297.70	2.09
249	000100	TCL 集团	10,692,406.00	2.07
250	300465	高伟达	10,673,189.00	2.07
251	300056	三维丝	10,434,479.38	2.02
252	601179	中国西电	10,387,332.56	2.01

注:1、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;

2、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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	600536	中国软件	288,990,864.60	56.06
2	300059	东方财富	232,148,260.66	45.03
3	300285	国瓷材料	230,370,670.95	44.69
4	601318	中国平安	222,987,749.76	43.25
5	600015	华夏银行	182,268,956.43	35.36
6	600958	东方证券	176,419,611.07	34.22
7	000651	格力电器	172,438,986.43	33.45
8	600085	同仁堂	169,761,160.83	32.93
9	000538	云南白药	169,130,312.68	32.81
10	601166	兴业银行	166,468,754.06	32.29
11	601211	国泰君安	155,178,860.17	30.10
12	600030	中信证券	147,666,571.32	28.64
13	600036	招商银行	137,088,075.69	26.59
14	600016	民生银行	133,424,671.54	25.88
15	601985	中国核电	127,368,423.15	24.71
16	000895	双汇发展	110,902,117.21	21.51
17	601288	农业银行	100,193,345.11	19.43
18	600000	浦发银行	98,462,848.56	19.10
19	002439	启明星辰	98,319,436.41	19.07
20	002230	科大讯飞	96,035,851.72	18.63
21	300017	网宿科技	95,030,407.19	18.43
22	000001	平安银行	93,918,341.47	18.22
23	000977	浪潮信息	87,162,242.75	16.91
24	002475	立讯精密	82,057,395.18	15.92
25	600597	光明乳业	80,659,184.04	15.65
26	002329	皇氏集团	79,466,623.41	15.41
27	600837	海通证券	78,097,213.78	15.15
28	002458	益生股份	76,477,844.64	14.83
29	601601	中国太保	73,292,939.62	14.22
30	600570	恒生电子	73,027,713.35	14.17
31	601668	中国建筑	72,587,080.84	14.08
32	600519	贵州茅台	72,292,650.62	14.02
33	600887	伊利股份	72,054,087.72	13.98
34	600705	中航资本	71,808,400.05	13.93
35	600038	中直股份	70,932,976.82	13.76
36	300458	全志科技	70,725,128.08	13.72
37	600179	黑化股份	68,159,198.82	13.22
38	300395	菲利华	67,905,865.07	13.17
39	300443	金雷风电	66,976,110.18	12.99
40	000568	泸州老窖	66,891,934.04	12.98
41	000625	长安汽车	64,981,980.31	12.60
42	000802	北京文化	62,366,055.95	12.10
43	002268	卫士通	59,829,977.78	11.61
44	000002	万科A	58,586,622.98	11.36
45	601818	光大银行	58,430,279.86	11.33
46	000750	国海证券	58,042,934.97	11.26
47	300444	双杰电气	57,918,248.62	11.23
48	600037	歌华有线	57,524,895.32	11.16
49	002292	奥飞动漫	56,467,086.73	10.95
50	600518	康美药业	56,441,271.48	10.95
51	601169	北京银行	56,347,989.50	10.93
52	300065	海兰信	55,495,136.64	10.76
53	300251	光线传媒	54,467,747.29	10.57
54	601058	赛轮金宇	53,823,746.20	10.44
55	002344	海宁皮城	53,329,768.94	10.34
56	601766	中国中车	52,986,414.68	10.28
57	600309	万华化学	52,475,045.26	10.18
58	600973	宝胜股份	52,069,909.09	10.10
59	600048	保利地产	51,147,588.02	9.92
60	601633	长城汽车	49,965,187.46	9.69
61	002236	大华股份	49,787,731.22	9.66
62	601988	中国银行	49,772,032.68	9.65
63	002153	石基信息	49,539,112.41	9.61
64	300369	绿盟科技	48,697,518.29	9.45
65	000423	东阿阿胶	48,592,923.49	9.43
66	000776	广发证券	48,564,853.32	9.42
67	600455	博通股份	48,454,525.57	9.40
68	300213	佳讯飞鸿	48,113,005.08	9.33
69	603022	新通联	45,517,147.32	8.83
70	000566	海南海药	44,808,381.28	8.69
71	601009	南京银行	44,740,078.31	8.68
72	300329	海伦钢琴	44,086,598.82	8.55
73	601628	中国人寿	43,739,151.33	8.48
74	600446	金证股份	43,129,322.34	8.37
75	002058	威尔泰	43,008,322.87	8.34
76	002013	中航机电	41,679,494.09	8.08
77	600999	招商证券	41,471,649.69	8.04
78	601390	中国中铁	41,193,055.05	7.99
79	601006	大秦铁路	40,256,883.27	7.81
80	002179	中航光电	39,711,879.18	7.70
81	600104	上汽集团	39,181,623.76	7.60
82	300133	华策影视	39,083,648.05	7.58
83	600690	青岛海尔	38,796,038.55	7.53
84	300140	启源装备	38,563,631.92	7.48
85	601939	建设银行	38,511,609.30	7.47
86	600637	东方明珠	38,240,970.07	7.42
87	600050	中国联通	38,217,666.43	7.41
88	601186	中国铁建	38,018,353.29	7.37
89	300462	华铭智能	37,838,843.73	7.34
90	601857	中国石油	37,759,041.24	7.32
91	600761	安徽合力	37,680,080.76	7.31
92	000333	美的集团	37,350,000.54	7.24
93	300037	新宙邦	37,092,404.34	7.19
94	600031	三一重工	36,989,549.70	7.17
95	600028	中国石化	36,318,088.83	7.04
96	600959	江苏有线	36,174,040.23	7.02
97	000915	山大华特	35,618,220.38	6.91
98	000592	平潭发展	34,898,844.74	6.77
99	000826	启迪桑德	34,309,302.79	6.66
100	603818	曲美家居	34,269,848.72	6.65
101	600276	恒瑞医药	34,197,898.85	6.63
102	300457	赢合科技	34,098,589.48	6.61
103	600352	浙江龙盛	33,622,925.56	6.52
104	601088	中国神华	32,928,956.37	6.39
105	002501	利源精制	32,908,492.03	6.38
106	000157	中联重科	32,557,494.20	6.32
107	300207	欣旺达	32,229,433.43	6.25
108	601688	华泰证券	31,376,447.04	6.09
109	603883	老百姓	31,344,822.46	6.08
110	600369	西南证券	31,195,778.86	6.05
111	601989	中国重工	30,665,421.89	5.95
112	000733	振华科技	30,655,774.80	5.95
113	300447	全信股份	30,504,929.42	5.92
114	002465	海格通信	30,441,442.69	5.90
115	601901	方正证券	30,234,390.45	5.86
116	601336	新华保险	30,105,681.21	5.84
117	600590	泰豪科技	29,654,208.30	5.75
118	600893	中航动力	29,647,586.85	5.75
119	600585	海螺水泥	29,263,692.09	5.68
120	002104	恒宝股份	28,963,084.69	5.62
121	601998	中信银行	28,933,869.40	5.61
122	002410	广联达	28,619,686.14	5.55
123	600018	上港集团	27,760,632.02	5.38
124	300452	山河药辅	27,441,684.61	5.32
125	300398	飞凯材料	27,154,861.87	5.27
126	000725	京东方A	26,977,145.27	5.23
127	300429	强力新材	26,469,502.60	5.13
128	002003	伟星股份	25,990,179.21	5.04
129	600372	中航电子	25,922,418.44	5.03
130	002676	顺威股份	25,901,132.02	5.02
131	300440	运达科技	25,837,415.17	5.01
132	000858	五粮液	25,347,548.34	4.92
133	300486	东杰智能	25,150,970.96	4.88
134	600768	宁波富邦	25,059,662.22	4.86
135	600089	特变电工	24,845,459.15	4.82
136	600184	光电股份	24,649,132.43	4.78
137	300450	先导智能	24,193,333.33	4.69
138	002294	信立泰	23,680,438.12	4.59
139	600011	华能国际	23,593,981.47	4.58
140	600383	金地集团	23,165,850.59	4.49
141	601618	中国中冶	23,090,635.04	4.48
142	600774	汉商集团	22,895,943.19	4.44
143	300428	四通新材	22,582,646.32	4.38
144	000338	潍柴动力	22,551,939.60	4.37
145	600019	宝钢股份	22,372,648.36	4.34
146	300228	富瑞特装	22,060,476.12	4.28
147	300379	东方通	21,679,859.77	4.21
148	002205	国统股份	21,514,193.38	4.17
149	603601	再升科技	21,422,953.51	4.16
150	601098	中南传媒	21,419,220.99	4.15
151	600765	中航重机	21,146,226.12	4.10
152	600109	国金证券	20,919,593.94	4.06
153	601800	中国交建	20,833,654.37	4.04
154	600410	华胜天成	20,404,519.27	3.96
155	000728	国元证券	20,392,830.94	3.96
156	600648	外高桥	20,294,964.31	3.94
157	600150	中国船舶	19,898,451.77	3.86
158	300406	九强生物	19,866,916.00	3.85
159	002024	苏宁云商	19,861,314.74	3.85
160	000785	武汉中商	19,721,906.53	3.83
161	002053	云南盐化	19,593,365.75	3.80
162	000793	华闻传媒	19,583,483.35	3.80
163	002500	山西证券	19,527,931.16	3.79
164	300252	金信诺	19,310,694.11	3.75
165	600029	南方航空	19,179,187.55	3.72
166	600900	长江电力	19,090,890.50	3.70
167	600280	中央商场	19,074,275.15	3.70
168	000783	长江证券	18,973,917.16	3.68
169	600010	包钢股份	18,329,430.78	3.56
170	601377	兴业证券	18,249,531.29	3.54
171	000166	申万宏源	18,175,783.02	3.53
172	002142	宁波银行	17,953,206.06	3.48
173	600703	三安光电	17,910,841.97	3.47
174	000402	金融街	17,723,970.76	3.44
175	600694	大商股份	17,685,597.52	3.43
176	600749	西藏旅游	17,573,723.70	3.41
177	300161	华中数控	17,486,200.67	3.39
178	300302	同有科技	17,444,831.57	3.38
179	601899	紫金矿业	17,437,489.82	3.38
180	603030	全筑股份	17,384,568.85	3.37
181	603729	龙韵股份	17,348,434.82	3.37
182	002241	歌尔声学	17,264,323.94	3.35
183	300377	赢时胜	17,256,615.78	3.35
184	002634	棒杰股份	17,148,432.63	3.33
185	000623	吉林敖东	16,804,726.20	3.26
186	600066	宇通客车	16,757,226.29	3.25
187	600315	上海家化	16,614,035.02	3.22
188	002002	鸿达兴业	16,593,833.95	3.22
189	000605	渤海股份	16,345,472.16	3.17
190	002202	金风科技	16,238,120.42	3.15
191	002558	世纪游轮	15,984,365.00	3.10
192	000063	中兴通讯	15,873,449.37	3.08
193	600535	天士力	15,790,471.53	3.06
194	300433	蓝思科技	15,746,896.32	3.05
195	000069	华侨城A	15,736,048.80	3.05
196	300016	北陆药业	15,652,573.83	3.04
197	600115	东方航空	15,636,042.49	3.03
198	000801	四川九洲	15,378,926.76	2.98
199	600674	川投能源	15,370,590.81	2.98
200	002169	智光电气	15,344,170.54	2.98
201	600741	华域汽车	15,016,222.76	2.91
202	000413	东旭光电	15,007,668.58	2.91
203	000014	沙河股份	14,949,287.70	2.90
204	000686	东北证券	14,734,440.75	2.86
205	600886	国投电力	14,714,960.15	2.85
206	002304	洋河股份	14,628,373.92	2.84
207	601111	中国国航	14,544,295.22	2.82
208	600068	葛洲坝	14,529,332.07	2.82
209	002234	民和股份	14,483,392.01	2.81
210	600177	雅戈尔	14,448,829.43	2.80
211	000009	中国宝安	14,346,831.23	2.78
212	600385	山东金泰	14,287,625.91	2.77
213	300101	振芯科技	14,223,758.04	2.76
214	600221	海南航空	14,113,285.58	2.74
215	000156	华数传媒	13,989,737.66	2.71
216	000792	盐湖股份	13,966,257.45	2.71
217	600717	天津港	13,901,748.36	2.70
218	002450	康得新	13,826,383.11	2.68
219	000539	粤电力A	13,688,478.14	2.66
220	300024	机器人	13,639,462.85	2.65
221	600583	海油工程	13,599,868.72	2.64
222	601607	上海医药	13,524,118.51	2.62
223	601669	中国电建	13,403,196.56	2.60
224	600196	复星医药	13,176,688.51	2.56
225	600867	通化东宝	13,171,999.64	2.55
226	600340	华夏幸福	13,129,921.47	2.55
227	600600	青岛啤酒	12,864,696.64	2.50
228	600079	人福医药	12,858,705.87	2.49
229	600111	北方稀土	12,809,082.96	2.48
230	600588	用友网络	12,765,688.24	2.48
231	300353	东土科技	12,762,828.20	2.48
232	300465	高伟达	12,714,834.73	2.47
233	300432	富临精工	12,711,636.20	2.47
234	600271	航天信息	12,614,071.26	2.45
235	601117	中国化学	12,595,598.69	2.44
236	002081	金螳螂	12,512,046.67	2.43
237	600009	上海机场	12,319,308.45	2.39
238	600578	京能电力	12,267,446.82	2.38
239	300003	乐普医疗	11,989,110.64	2.33
240	002757	南兴装备	11,969,654.50	2.32
241	000100	TCL 集团	11,647,676.73	2.26
242	600415	小商品城	11,616,938.75	2.25
243	300056	三维丝	11,573,805.34	2.24
244	000039	中集集团	11,517,895.10	2.23
245	600332	白云山	11,511,797.15	2.23
246	300274	阳光电源	11,495,065.91	2.23
247	600863	内蒙华电	11,295,064.19	2.19
248	600423	柳化股份	11,177,190.37	2.17
249	300471	厚普股份	10,939,780.61	2.12
250	002673	西部证券	10,852,092.53	2.10
251	601179	中国西电	10,749,331.86	2.09
252	300430	诚益通	10,653,021.25	2.07
253	002456	欧菲光	10,629,524.59	2.06
254	600166	福田汽车	10,605,888.70	2.06
255	600689	上海三毛	10,585,795.66	2.05
256	600795	国电电力	10,523,735.92	2.04
257	002400	省广股份	10,496,869.04	2.04

注:1、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;

2、卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

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

买入股票成本(成交)总额	13,144,266,211.76
卖出股票收入(成交)总额	12,563,531,187.40

注:买入股票成本、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。

8.5 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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	631,509,000.00	8.30
	其中:政策性金融债	631,509,000.00	8.30
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	9,192,198.80	0.12
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	640,701,198.80	8.42

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

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	150211	15国开11	2,500,000	250,725,000.00	3.30
2	140305	14进出05	1,500,000	150,555,000.00	1.98
3	150301	15进出01	1,000,000	100,090,000.00	1.32
4	130202	13国开02	1,000,000	100,040,000.00	1.31
5	150307	15进出07	300,000	30,099,000.00	0.40

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投资。

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

8.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1601	IC1601	-22	-32,555,600.00	566,430.77	–
IF1601	IF1601	-605	-666,613,200.00	6,788,220.00	–
IH1601	IH1601	-728	-524,946,240.00	-402,240.00	–
公允价值变动总额合计(元)					6,952,410.77
股指期货投资本期收益(元)					82,527,703.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					29,288,207.00

8.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资是为了对冲股权买入方的投资。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2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投资,也无期间损益。

8.11.3本期国债期货投资评价

本报告期内,本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	249,469,152.94
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	24,428,602.40
5	应收申购款	457,431.93
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	274,355,187.27

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300471	厚普股份	69,799,937.60	0.92	网下新股自愿锁定

§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

份额级别	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		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
工银绝对收益混合发起A	9,145	651,536.39	5,599,731,922.73	93.98%	358,568,389.83	6.02%
工银绝对收益混合发起B	3,354	247,502.32	654,770,132.03	78.88%	175,352,662.19	21.12%
合计	12,499	543,117.30	6,254,502,054.76	92.13%	533,921,052.02	7.87%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	工银绝对收益混合发起A	0.00	0.00%
	工银绝对收益混合发起B	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

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	份额级别	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	工银绝对收益混合发起A	0
	工银绝对收益混合发起B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	工银绝对收益混合发起A	0
	工银绝对收益混合发起B	0
	合计	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,002,960.00	0.13	9,002,960.00	0.13	–
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	992,523.49	0.01	992,523.49	0.01	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	9,995,483.49	0.14	9,995,483.49	0.14	–

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	工银绝对收益混合发起A	工银绝对收益混合发起B
基金合同生效日(2014年6月26日)基金份额总额	516,916,982.06	999,555,609.63
本报告期期初基金份额总额	245,011,756.25	266,760,553.97
本报告期基金总申购份额	13,163,961,257.14	18,745,188,448.63
减:本报告期基金总赎回份额	7,450,672,700.83	18,181,826,208.38
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	5,958,300,312.56	830,122,794.22

注:1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额;

2、报告期期间基金总赎回份额含定期支付机制下自动赎回的基金份额以及转换出份额。

§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,本基金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

1、基金管理人

基金管理人于2015年4月28日在指定媒介上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,经基金管理人第四届董事会第四次会议审议并通过,毕万英先生不再担任副总经理职务。

基金管理人于2015年6月2日在指定媒介上披露了《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,经基金管理人第四届董事会第七次会议审议并通过,库三七先生不再担任副总经理职务。

基金管理人于2015年9月16日在指定媒介上披露了《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》,经基金管理人第五十七次股东会和第四届董事会第十次会议审议通过,陈焕祥先生辞去公司董事长职务,董事长变更为沈立强先生。

2、基金托管人

本报告期内,交通银行股份有限公司(以下简称"本行")因工作需要,刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁,任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。

袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在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,无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期无投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用拾万元整,该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

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,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	1	8,110,855,021.57	31.89%	5,664,084.33	28.89%	–
长城证券	1	3,896,620,203.15	15.32%	2,771,663.57	14.13%	–
安信证券	2	3,458,737,836.69	13.60%	2,460,197.16	12.55%	–
新时代证券	2	1,076,793,942.55	4.23%	765,924.31	3.91%	–
国信证券	2	8,890,837,425.64	34.96%	7,947,070.14	40.53%	–
乾坤期货	1	–	–	–	–	–
东证期货	1	–	–	–	–	–

注:1.券商的选择标准和程序

(1)选择标准:注重综合服务能力

a)券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b)券商具有较强的综合研究能力:能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及其他丰富全面的信息咨询服务;有很强的分析能力,能根据工银瑞信所管理基金的特定要求,提供专门研究报告;具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

c)与其他券商相比,该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2)选择程序

a)新增券商的选定:根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前,券商需提供至少两个季度的服务,并与其他已合作券商一起参与投资研究部门(权益投资部,固定收益部,专户投资部,研究部和中央交易室)两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。

b)签订委托协议:与被选择的券商签订委托代理协议,明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等,经签章有效。委托代理协议一式五份,协议双方及证券主管机关各留存一份,我方协议由研究部和战略发展部存档,并报相关证券主管机关留存报备。

2.券商的评估、保留和更换程序

(1)席位的租用期限暂定为一年,合同到期15天内,投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况,进行评估。

(2)对于符合标准的券商,工银瑞信将与其续约;对于不能达到标准的券商,不与其续约,并根据券商选择标准和程序,重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构,租用其交易席位。

(3)若券商提供的综合证券服务不符合要求,工银瑞信有权按照委托协议规定,提前中止租用其交易席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	4,525,142.50	100.00%	6,846,200,000.00	23.87%	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	12,110,000,000.00	42.22%	–	–
新时代证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	9,729,200,000.00	33.92%	–	–
乾坤期货	–	–	–	–	–	–
东证期货	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1.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》,自2015年3月26日起,本基金管理人对旗下证券投资基金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),主要依据由第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的价格数据进行估值。详情请见2015年3月27日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站发布的《工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

2.根据基金管理人于2015年8月20日披露的《工银瑞信基金管理有限公司关于增聘基金经理的公告》,自2015年8月18日起,增聘胡志利先生担任工银瑞信绝对收益策略混合型发起式证券投资基金基金经理。