



Disclosure 信息披露

2015年3月26日 星期四
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B207

(上)B205续

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	002750	宁德时代	76,438,954.41	2.62
2	002405	四维图新	71,724,847.19	2.55
3	002185	华天科技	63,445,933.18	2.26
4	600036	招商银行	52,378,483.32	1.86
5	600318	康美药业	48,811,851.92	1.74
6	600030	中信证券	46,632,536.71	1.67
7	600875	东方电气	45,735,881.12	1.63
8	300177	中恒电气	43,165,083.45	1.53
9	600703	三安光电	42,908,853.13	1.53
10	600240	华业地产	41,379,596.93	1.47
11	601118	中国平安	40,348,598.82	1.43
12	600872	中航高新	39,678,427.71	1.41
13	002796	星网锐捷	36,430,604.04	1.40
14	601299	中国北车	36,603,490.99	1.37
15	002342	九鼎投资	36,101,135.45	1.28
16	002529	亿嘉和	32,603,356.60	1.16
17	601600	中国交建	30,464,347.29	1.08
18	601668	中国建筑	29,838,986.00	1.06
19	002924	比亚迪	28,000,237.77	1.01
20	600498	五矿股份	25,806,401.43	0.92
8.3	合计		1,462,859,401.31	

买入股票成本、成交金额、期间买入股票的成本(成交金额扣除佣金和印花税)列后,不考虑相关交易费用。
8.3 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	1,308,447,000.00	47.81
4	其中:政策性金融债	1,308,447,000.00	47.81
5	企业债	30,327,000.00	1.11
6	企业短期融资券	-	-
7	中期票据	-	-
8	其他	5,758,463.20	0.21
9	合计	1,344,532,463.20	49.13

8.4 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

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	130228	13国债28	2,500,000	250,450,000.00	9.15
2	140228	14国债28	2,500,000	250,460,000.00	9.15
3	120204	12国债04	2,000,000	199,100,000.00	7.27
4	130226	13国债26	1,800,000	180,036,000.00	6.58
5	130227	13国债27	1,600,000	160,016,000.00	5.85

8.5 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.6 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.7 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.8 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.9 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.10 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.11 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.12 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.13 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细
8.14 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名权证投资明细

序号	名称	金额	占基金资产净值比例 (%)
1	存出保证金	675,831.31	-
2	应收证券清算款	-	-
3	应收利息	-	-
4	应收股利	34,953,087.11	-
5	应收中融款	-	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	35,628,540.42	-

8.14 期末持有的衍生工具资产和负债情况

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113005	国债逆回购	5,758,463.20	0.21

8.15 期末持有的衍生工具资产和负债情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
1	股权投资	861,628,764.66	83.85
2	其中:股票	861,628,764.66	83.85
3	中期收益投资	2,883,000.00	0.28
4	其中:债券	2,883,000.00	0.28
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
8	其他	162,551,827.51	15.82
9	其他资产	538,539.74	0.05
10	合计	1,027,602,131.91	100.00

8.2 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

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	600885	海南工程	101,019,044.71	10.55
2	601607	中航光电	77,147,869.52	8.06
3	601118	中国平安	62,950,355.35	6.54
4	600900	青岛啤酒	62,650,498.24	6.54
5	002557	浔兴股份	57,228,106.96	5.98
6	602594	比亚迪	51,329,446.14	5.36
7	600511	国药股份	49,259,229.94	5.15
8	002230	科大讯飞	48,082,783.62	5.02
9	002313	奥飞娱乐	41,339,547.00	4.32
10	002992	平安证券	40,000,000.00	4.17
11	300131	荣泰新材	32,231,980.37	3.37
12	002242	爱康集团	30,422,514.64	3.18
13	600388	龙净环保	29,673,208.66	3.10
14	601601	中国太保	29,451,798.82	3.08
15	000838	国兴地产	27,843,223.57	2.91
16	600036	招商银行	27,768,256.01	2.90
17	002327	富安娜	27,338,130.49	2.86
18	600875	东方电气	26,001,367.35	2.72
19	600100	中信证券	25,219,691.58	2.63
20	601608	中信银行	24,948,677.00	2.61
21	601136	新宇股份	24,256,998.78	2.53
22	600828	中国石化	22,244,562.34	2.32
23	002020	华业地产	21,163,808.33	2.21
24	601166	兴业银行	20,180,042.81	2.11
25	600518	中信证券	19,951,454.67	2.08

8.3 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

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	110303	格力转债	28,830	2,883,000.00	0.30

8.4 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
1	股权投资	861,628,764.66	83.85
2	其中:股票	861,628,764.66	83.85
3	中期收益投资	2,883,000.00	0.28
4	其中:债券	2,883,000.00	0.28
5	资产支持证券	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售的买入返售金融资产	-	-
8	其他	162,551,827.51	15.82
9	其他资产	538,539.74	0.05
10	合计	1,027,602,131.91	100.00

8.2 债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.72	
2	其中:买入返售金融资产	-	
3	其中:卖出回购金融资产	-	
4	报告期内债券回购融资余额	22,999,645.50	8.37
5	其中:买入返售金融资产	-	-
6	其中:卖出回购金融资产	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3 投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期内投资组合平均剩余期限	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	97

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金合同约定:“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期内,本基金未发生超标情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	51.79	8.37
2	30天(含)-60天	16.24	-
3	60天(含)-90天	-	-
4	90天(含)-180天	3.64	-
5	180天(含)-397天(含)	34.58	-
6	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
7	合计	107.48	8.37

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	14,951,667.29	5.44
4	其中:政策性金融债	14,951,667.29	5.44
5	企业债	-	-
6	企业短期融资券	135,001,579.23	49.15
7	中期票据	-	-
8	其他	-	-
9	合计	149,953,246.52	54.60

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前10名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	04148078	14国债07	19,984,040.77	7.28
2	04146004	14国债04	200,000	0.07
3	04145003	14国债03	100,000	0.04
4	04136246	14国债26	100,000	0.04
5	140207	14国债07	100,000	0.04
6	04145037	14国债03	100,000	0.04
7	04160070	14国债07	100,000	0.04
8	04146002	14国债02	100,000	0.04
9	04145803	14国债03	100,000	0.04
10	04145801	14国债01	100,000	0.04

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%至0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最大值	0.0209%
报告期内偏离度的最小值	-0.1111%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的平均值	0.0439%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10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。

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	002750	宁德时代	28,686,511.83	3.00
2	J	基金	192,960,034.82	20.12
3	K	基金	226,669,654.14	23.68
4	L	基金	-	-
5	M	基金	-	-
6	N	基金	-	-
7	O	基金	-	-
8	P	基金	-	-
9	Q	基金	-	-
10	R	基金	-	-
11	S	基金	-	-
12	T	基金	-	-
13	U	基金	-	-
14	V	基金	-	-
15	W	基金	-	-
16	X	基金	-	-
17	Y	基金	-	-
18	Z	基金	-	-
19	合计		1,185,000,000	12.4
20	合计		861,628,764.66	90.36

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

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	600036	招商银行	3,076,796	51,043,879.74	5.33
2	600240	华业地产	4,781,812	47,770,301.88	4.99
3	600000	浦发银行	2,863,470	44,927,844.30	4.69
4	000718	苏宁环球	6,288,911	42,124,471.03	4.40
5	601607	中航光电	2,324,626	38,356,329.00	4.01
6	600185	格力电器	1,699,969	37,969,318.00	3.91
7	000709	河钢股份	8,000,000	30,660,000.00	3.20
8	601118	中国平安	400,000	29,808,467.69	3.12
9	000252	广信股份	1,614,040	26,513,464.20	2.77
10	002658	霞客环保	961,241	26,275,717.44	2.77

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

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	002220	科大讯飞	62,823,187.96	6.56
2	600060	青岛啤酒	61,642,779.37	6.44
3	600036	招商银行	43,955,046.16	4.58
4	000718	苏宁环球	38,330,979.14	4.00
5	000838	国兴地产	27,469,320.83	2.87
6	600158	中信证券	26,968,418.09	2.82
7	600000	浦发银行	24,690,000.00	2.56
8	000709	河钢股份	23,599,107.55	2.46
9	600185	格力电器	23,257,801.23	2.43
10	300131	荣泰新材	23,520,309.00	2.45
11	601118	中国平安	22,820,240.00	2.38
12	000031	中粮地产	21,267,514.07	2.22
13	600016	民生证券	19,798,200.00	2.07
14	010696	宁波中力	19,520,223.96	2.04
15	600030	中信证券	19,333,920.44	2.02
16	600063	中国通讯	18,768,111.32	1.96
17	600837	海南发展	16,980,182.00	1.77
18	600466	海信电器	15,530,491.76	1.61
19	000699	伊泰煤炭	15,597,551.30	1.61
20	000992	平安证券	13,018,885.70	1.37

8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

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 (%)
----	------	------	----------	-----------------