

B191

计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。				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	000002	万科A	183,169,420.87	6.60
2	600837	海通证券	138,076,158.25	4.98
3	601318	中国平安	138,022,347.11	4.98
4	000024	招商地产	133,770,189.88	4.82
5	600016	民生银行	129,121,055.92	4.66

6	600519	贵州茅台	121,311,043.14	4.37
7	601166	兴业银行	117,958,937.62	4.25
8	000651	格力电器	110,824,138.11	4.00
9	300027	华谊兄弟	96,747,688.16	3.49
10	002241	歌尔声学	85,159,503.33	3.07
11	600015	华夏银行	70,671,690.96	2.55
12	002038	双鹭药业	66,898,974.53	2.41
13	300251	光线传媒	64,044,152.34	2.31
14	600340	华夏幸福	63,191,965.18	2.28
15	600518	康美药业	52,840,996.59	1.91
16	002310	东方园林	49,635,245.21	1.79
17	600637	百视通	48,206,989.33	1.74

18	600036	招商银行	47,699,928.95	1.72
19	600030	中信证券	46,735,162.11	1.69
20	002344	海宁皮城	46,340,410.07	1.67
*卖出回购协议成交金额(或卖出回购金额以成交数量)期间,不考虑相关交易费用。				
13.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
买入股票收入(或卖)总额			5,026,203,918.91	
卖出股票收入(或买)总额			5,211,186,140.98	
*买入或卖出“指定交易股票”期间,均按买入或卖出成交金额(或成交金额以成交数量)期间,不考虑相关交易费用。				
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	99,710,000.00	3.03	

3	金融债券	568,792,000.00	17.28
	其中：政策性金融债	568,792,000.00	17.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,639,293.81	0.11
8	其他	-	-
9	合计	672,141,293.81	20.42

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	130218	13国开18	1,600,000	158,992,000.00	4.83
2	1301032	11年行票附 32	1,000,000	99,710,000.00	3.03
3	1301036	13国开36	600,000	59,586,000.00	1.81
4	130308	13进债18	500,000	49,595,000.00	1.51
5	130426	13农发26	500,000	49,195,000.00	1.49

期末按公允价值计量的金融资产净值比期末排名的前十名资产支持证券投资市值
基本本报告期末未有资产支持证券。
期末公允价值计量的金融资产净值比期末排名的前五名权证投资明细
基本本报告期末未持有权证。
报告期内本基金投资的前十名证券的融资交易情况说明
基本本报告期末未投资股指期货。
报告期内本基金投资的前十名证券的融资交易情况说明
基本本报告期末未投资股指期货。
1.1 投资组合报告附注
1.1.1 报告期内基金投资的前十名证券中有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、处罚的基金投资的前十名证券没有超过基金合同规定的备选股票库。
1.1.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

序号		名称	金额
1	存出保证金		553,642.62
2	应收证券清算款		30,190,449.11
3	应收股利		-
4	应收利息		11,562,467.84
5	应收申购款		-
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-

8	其他		-		
9	合计		42,306,559.57		
1.3.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细					
			金额单位：人民币元		
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	
1	110002	同仁转债	537,242.00	0.02	
1.3.5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	300058	蓝色光标	公允价值	(%)	明
			8,960,000.00	0.27	非公开发行流通受限
1 期末基金份额持有人户数及持有人结构					
§9 基金份额持有人信息					
					单位数:份
持有人户数(户)	户均持有的基金份额		持有人结构		个人投资者
			持有份额	占比份额(%)	占比总额(%)
29,122	103,014.90		1,649,126.222	34.9%	1,350,873.778
					43.0%
2 期末上市前十名持有人					
序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例		

1	中国人寿保险(集团)公司	387,854,086.00	12.93%
2	中国人寿保险股份有限公司	289,999,926.00	9.67%
3	易方达基金管理有限公司	219,110,562.00	7.30%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司-万能-个人万能	52,997,489.00	1.77%
5	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	51,466,254.00	1.72%
6	中国平安保险(集团)股份有限公司	47,709,022.00	1.59%
7	中国人寿财产保险股份有限公司	44,115,686.00	1.47%

7	司—传统—普通保险产品	41,123,688.00	1.97%
8	太平人寿保险有限公司	49,671,000.00	1.39%
9	伦敦市投资管理有限公司—客户资金	40,716,541.00	1.36%
10	泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 沪	35,168,393.00	1.17%

3.期末基金管理人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	0.00	0%

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人员持有本基金份额总数的区间为0%；本基金的基金管理人持有本基金份额总数的区间为0%。

§ 10 重大事件揭示

1. 基金持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

2. 基金管理人、基金托管人及基金销售机构的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人及基金销售机构未发生任何重大人事变动。2013年12月12日聘任马骏先生任公司副总经理；基金管理人于2013年12月17日发布公告，自2013年12月16日起聘任马骏先生不再担任公司副总经理。基金管理人持有的有证基金管理人、基金托管人及基金销售机构无变化。

3. 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

4. 基金投资范围的改变

报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

5. 基金为进行资产估值而调整估值方法

报告期内，本基金未调整估值方法。本基金会计估值准备（除特殊事件外）提供估值服务。本报告期内未发生因估值方法调整而导致的基金资产估值重大调整。

1.00 000.00元。	
16. 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查处罚等情况	
17. 基金的主要业务管理人及托管人受稽查处罚以及其高级管理人员未受到任何稽查处罚情况	
18. 基金租用证券公司交易单元的有关情况	
19. 基金租用证券公司交易单元用于股票投资及佣金支付情况	金额单位:人民币元

银河证券	1	8,581,147.50	0.08%	7,812.33	0.08%	-
湘财证券	1	203,790,400.53	2.00%	185,531.17	2.00%	-
申银万国	1	167,005,377.81	1.64%	152,042.62	1.64%	-
上海证券	1	523,263,352.15	5.13%	476,376.83	5.14%	-
山西证券	1	672,922,603.33	6.59%	609,814.86	6.58%	-
齐鲁证券	2	67,613,848.50	0.66%	61,554.69	0.66%	-
平安证券	1	1,431,593,752.79	14.02%	1,297,429.93	14.00%	-
南京证券	1	39,922,736.94	0.39%	36,345.09	0.39%	-
国元证券	1	152,231,074.76	1.49%	136,027.71	1.42%	-

国信证券	1	1,515,067,260.32	14.84%	1,372,660.44	14.81%	-
国泰君安	2	451,445,051.69	4.42%	410,996.48	4.43%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	646,719,955.01	6.34%	588,778.37	6.35%	-
光大证券	1	739,414,588.94	7.24%	763,161.97	7.26%	-
长城证券	1	1,033,196,577.93	10.12%	940,625.03	10.15%	-
财富证券	1	328,670,587.38	3.22%	299,221.13	3.25%	-
财达证券	1	1,416,748,217.64	13.88%	1,283,182.71	13.84%	-

[illegible]

券商名称	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
招商证券	--	--	--	--	--	--
银河证券	--	--	--	--	--	--
湘财证券	--	--	--	--	--	--
申银万国	--	--	--	--	--	--

上海证券	--	--	--	--	--
山西证券	--	--	--	--	--
齐鲁证券	--	--	--	--	--
平安证券	--	--	--	--	--
南京证券	--	--	--	--	--
国元证券	--	--	--	--	--
国信证券	--	--	--	--	--
国泰君安	--	--	--	--	--

国联证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	2,240,007.20	100.00%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

东方财富基金管理有限公司
 二〇一四年三月二十八日