

B239

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000729	辽宁成大	49,362,635.73	33.32
2	300053	华鲁制药	47,656,461.24	32.21
3	601888	中国国旅	25,114,546.24	14.35
4	600406	国电南瑞	18,520,351.10	12.82
5	600581	用友软件	17,667,195.78	11.58

7	60009	南京银行	12,877,200.00	9.76
8	000726	鲁信证券	13,643,211.24	9.70
9	000001	中国平安	12,296,393.02	8.84
10	002800	山西证券	11,970,118.42	8.43
11	000099	招商证券	11,760,268.98	7.98
12	000847	海康威视	11,151,137.01	7.91
13	000040	长江证券	11,150,940.29	7.88
14	000778	东方集团	11,030,027.86	7.84
15	005333	东兴证券	11,279,627.90	7.72

17	000000	合众国际	11,200,040.56	7.60
18	000000	中国燃气	30,900,040.00	7.60
19	000076	开普股份	10,600,038.18	7.58
20	000026	通化东阿	10,000,035.91	7.58
21	000063	源发股份	10,100,033.63	7.57
22	000100	永昌材料	9,900,029.07	7.57
23	000019	保得股份	9,700,024.09	7.55
24	000040	美利纸业	9,600,020.67	7.55
25	000070	福建路桥	9,500,019.00	7.55
26	000064	中国五矿	9,400,016.46	7.52
27	000032	康美药业	8,200,014.57	7.54
28	000001	万科A	8,700,010.00	7.54
29	000006	大冶特钢	8,600,007.92	7.50
30	000000	燕京啤酒	8,500,009.60	7.50
31	000017	美都能源	8,400,007.60	7.50
32	000061	金发科技	8,000,011.00	7.50
33	000011	招商局A	8,400,000.00	7.50
34	000234	航天长峰	8,600,000.00	7.50
35	000003	浦发银行	8,400,000.00	7.50
36	000073	美盈股份	8,100,010.00	7.50
37	000006	金城股份	8,000,010.00	7.50
38	000022	中农资源	8,000,010.00	7.50
39	000041	二六三	8,000,010.00	7.50
40	000100	广汽集团	8,000,000.00	7.50
41	000000	中信证券	8,200,012.12	7.50
42	000070	浙江富润	8,200,011.75	7.50
43	000070	浙江富润	8,200,000.00	7.50
44	000060	中金黄金	8,000,000.00	7.50
45	000003	浦发银行	8,000,000.00	7.50

47	000049	光大证券	7,952,260.00	5.46
48	000078	三联商社	7,926,267.00	5.40
49	000019	深深房B	7,916,201.00	5.38
50	000007	华能股份	7,911,490.00	5.38
51	002465	海得装备	7,898,099.32	5.35
52	000011	招商局港口	7,904,613.00	5.35
53	000001	浦发银行	7,893,889.00	5.35
54	000077	华远集团	7,890,110.00	5.32
55	000066	国药控股	7,880,616.00	5.32
56	000036	华能水电	7,875,649.00	5.30
57	000068	华能国际	7,865,019.00	5.29
58	000003	浦发银行	7,862,963.00	4.88
59	000042	深圳机场	7,171,227.49	4.07
60	000005	民生证券	7,118,753.00	4.84
61	000808	中国远洋	7,070,764.00	4.80
62	000060	中金公司	7,018,869.00	4.78
63	000043	深圳机场	6,976,015.68	4.72
64	000047	东方宾馆	6,868,745.73	4.03
65	002666	德康药业	6,839,980.00	4.64
66	000020	中国石化	6,826,314.00	4.64
67	000062	东方宾馆	6,807,398.30	4.63
68	000026	红日药业	6,804,800.43	4.62
69	002019	中航资本	6,790,533.00	4.59
70	000080	中国远洋	6,661,222.73	4.58
71	000066	浦发银行	6,662,226.00	4.58
72	002050	中国联通	6,558,553.00	4.50
73	000079	四川美丰	6,438,418.21	4.26
74	002029	华鲁股份	6,408,554.13	4.25
75	000026	中国石化	6,328,664.00	4.25
76	000027	华鲁股份	6,277,647.78	4.20
77	000071	北京国信	6,255,415.00	4.20
78	002034	润都股份	6,200,210.20	4.20
79	000026	中国石化	6,177,895.00	4.19
80	002039	华鲁股份	6,172,048.00	4.19
81	000028	中国石化	6,164,964.50	4.19
82	000888	峨边山山	6,022,062.72	4.07

84	600572	康星	5,994,243.78	4.07
85	300232	洲明科技	5,975,334.13	4.06
86	300074	华平股份	5,942,828.00	4.03
87	300170	汉得信息	5,907,850.17	4.04
88	300024	机器人	5,784,733.21	3.93
89	603072	浙江环保	5,777,064.30	3.92

91	600276	恒瑞医药	5,438,189.83	3.69
92	300086	先一科技	5,436,249.25	3.69
93	000055	中国黄金	5,391,486.08	3.66
94	003005	晶方科技	5,388,453.31	3.66
95	300017	网宿科技	5,348,457.84	3.63
96	002680	莱宝光电	5,298,486.20	3.53
...	*****	地区名称	5,298,486.20	...

98	601111	中国国航	3,858,932.00	3.43
99	001050	江铃汽车	3,046,730.62	3.21
100	600390	山东高速	4,987,855.75	3.36
101	600911	华能国际	4,086,039.32	3.32
102	000002	万科A	4,804,700.63	3.26
103	002010	传化股份	4,799,885.98	3.23
104	002327	新时达	4,649,077.22	3.34

105	000801	江中制药	4,099,462.50	3.02
106	022223	鱼跃医疗	4,343,253.49	3.18
107	001313	江南嘉捷	4,534,825.32	3.08
108	002866	天齐矿业	4,478,248.36	3.04
109	002502	宝鼎重工	4,428,603.24	3.03
110	600027	华电国际	4,326,527.41	2.94
111	003111	康辰药业	4,315,446.14	2.79

113	00060	德金股份	4,055,872.00	2.73
114	002325	洪涛股份	3,890,897.66	2.64
115	300383	龙星家园	3,887,158.71	2.64
116	002323	尚符高新	3,882,678.97	2.64
117	002296	顺微科技	3,841,486.49	2.61
118	000719	大家传媒	2,788,313.58	2.52

120	300339	康星糖业	3,724,579.32	2.53
121	600777	东方雨虹	3,650,715.86	2.48
122	600325	华发股份	3,600,412.08	2.44
123	600435	北方导航	3,405,860.00	2.37
124	000997	新大陆	3,438,392.00	2.35
125	601766	中国南车	3,302,744.25	2.17
126	300771	德威科技	3,174,800.00	2.15

127	600577	鼎泰新材	3,119,822.68	2.13
128	002116	捷成通讯	2,508,763.25	2.65

注：卖出包括二级市场买入主动的卖出、换股、要约收购、发行回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（或成交净价以成交数量）计算，不考虑相关交易费用。

6.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(或卖出股票收入)	1,303,262,982.63
卖出股票收入(或买入股票成本)	1,302,964,688.08

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照买卖成交金额（或成交净价以成交数量）计算，不考虑相关交易费用。

6.0 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。

6.1 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。

6.2 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。

6.3 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。

6.4 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
6.4.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

以公允价值计量投资品种的公允价值。

（1）本基金采用公允价值计量属性进行估值。（2）本基金采用公允价值进行估值和国债投资。

（3）本报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）1.1 本期国债期货投资政策

本基金采用公允价值计量属性进行估值。

（2）1.2 持仓报告

本基金采用公允价值进行估值和国债投资。

（3）1.3 本期国债期货投资评价

本基金采用公允价值计量属性进行估值。

（4）1.4 投资限制

（5）1.5 投资组合报告

序号	名称	金额
1	存出保证金	579,074.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

3	应收申购款	101,843.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	685,779.11

6.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券余额

本基金本报告期末未持有可转换债券。

本基金按照前期末十名投资者中不存在他处披露情况。

ALL 28 投资者符合前节所述的其他文字表述是来自于四万五千人, 分派之和与合计可能有些误差。

§ 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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	份额单位(份)			
		投资者结构			
		机构投资者	个人投资者		
		投资者数	占总份额比例	投资者数	占总份额比例

6.3 国家基金管理人从业人员持有本基金的情况		
持有户数(n^1)	持有基金份额(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	0.00%

本报告期末基金管理人从业人员未持有本基金份额。

6.4 期末基金管理人从业人员持有开放式基金投资最近时间的情况

本报告期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及基金经理人未持有开放式基金份额。

\$ 10 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期初基金份额总额	-
基金合同生效日至报告期末本基金申购份额	41,563,580.38
减:基金合同生效日至报告期末本基金总赎回份额	509,766,112.79
基金合同生效日至报告期末本基金总申购份额,份额减少以“-”填列	-
本报告期末基金份额总额	126,475,048.25

注:总申购份额含红利再投、投资人申购,总赎回份额含转出份额。

§ 11 重大事件揭示

报告期内无基金份额持有人大会决议。	
基金管理人、基金托管人履行《基金管理人职责》的重大人事变动	
2017年12月15日，本基金管理人经中国证监会基金部备案核准，任命陈斌为督察长，同时原督察长李树刚辞任公司督察长职务并在中国证监会证券投资基金业协会进行备案。	
本报告期内，经中国证监会深圳监管局以及“以周永丰”工作专班，周永丰不再担任行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成受托投资管理基金业务管理职责的前提下，由副总经理王立波同志代为履行本行资产托管部总经理部分业务职责。	
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	

11.4	基金投资策略的改变	
	本基金报告期内投资策略未改变。	
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	
	本基金提供审计服务的会计师事务所为瑞华会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期内未发生变更。	
11.8	管理人、托管人及其高级管理人员受监管处罚等情况	
	报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查处罚或惩戒的情况。	
11.9	基金租用证券公司交易单元的有关情况	
11.9.1	基金租用证券公司交易单元用于证券投资及佣金支付情况	

	券股名称	交易单元数量	股票交易		应收支付券息明细		备注
			成交金额	占有期股票 成交总额的比例	佣金	占有期佣金 总额的比例	
	中债中证		752,000,435.70	32.89%	534,263.77	32.89%	-
	国海中证	2	507,951,713.52	25.72%	47,683.69	25.72%	-
	华安中证		40,972,297.74	20.54%	33,867.78	20.56%	-
	华夏中证	1	454,819,706.59	19.80%	323,105.05	19.80%	-

中证指数有限公司	2	21,444,034,000.00	0.0000%	18,253,390.00	0.0000%
----------	---	-------------------	---------	---------------	---------

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金估值定价有关问题的通知》（证监会公告〔2008〕4号）的有关规定，我公司按照与中证指数有限公司签订的估值委托协议，按中证指数有限公司提供的估值数据进行估值。

A. 估值程序

- 1、公司严格执行规范，资产状况和经营情况良好；
- 2、公司具有较稳定的研究能力，能及时、全面地为基金经理提供高质量的研究数据，行业研究和个股走势，个股分析报告及时研究数据；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的需要要求；
- 4、建立了及时的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B. 估值程序

公司研究部门定期将基金估值数据从以下方面进行量化分析，并开展估值的结果反馈流程：

- 1、服务的主动性，主要对中证公司估值数据提供反馈，及时对基金上估值数据，以及提供有关专题提供研究报告和决策。

证券名称	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	--	--	630,000,000.00	48.76%	--	--
国海证券	306,163.20	100.00%	638,000,000.00	47.86%	--	--

东富证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§ 32 影响投资者决策的其他重要信息

公司股东大会2015年第一次会议选举向松伟为公司第一届董事会独立董事，王为松不再担任公司独立董事。

前海开源基金管理有限公司
2015年3月27日