

B.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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	000887	伊利股份	13,358,914.04	1.28
2	005667	新华医疗	9,367,436.53	0.90
3	004398	海澜之家	7,756,102.65	0.75
4	008872	中炬高新	7,724,837.36	0.74

5	600261	阳光照明	6,026,207.88	0.58
6	600422	昆明制药	5,603,376.60	0.54

7	601718	阿平集团	5,312,237.00	0.51
8	600737	中粮屯河	4,505,848.00	0.43
9	600704	物产中大	4,258,436.80	0.41
10	600998	九州通	4,083,523.79	0.39
11	600556	中国医药	4,045,434.12	0.39
12	600633	浙报传媒	3,821,886.25	0.37
13	603288	海天味业	3,558,013.22	0.34
14	600073	上海梅林	3,509,097.97	0.34
15	601933	永辉超市	3,386,684.52	0.33
16	600519	贵州茅台	3,344,302.51	0.32

17	600873	鲁信发展	3,298,119.97	0.32
18	600551	时代新材	3,095,044.66	0.29
19	600737	东方电缆	2,895,819.82	0.28
20	600482	风神股份	2,753,907.00	0.26

注1：买入包括基金一级市场上上市的买入、新股、配股、债转股、换股及支付其取得的所有权，不包括因投资者申购赎回导致的基金组合中股票的投资；

注2：“买入成本金额”按买入成本金额（含买入的溢价或成交溢价）计算，不考虑相关交易费用；

8.42 累计卖出金额超过初始申购基金资产净值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	600655	豫园商城	7,767,087.88	0.78
2	600637	东方雨虹	6,786,148.16	0.67
3	900837	东方明珠	6,132,963.96	0.59

4	600519	贵州茅台	5,983,627.24	0.58
5	600104	上汽集团	5,547,133.76	0.53
6	600508	*ST大港	5,411,697.98	0.53
7	600132	重庆啤酒	4,096,772.11	0.39
8	600851	海澜股份	3,880,331.06	0.37
9	600559	广越龙山	3,651,846.57	0.35
10	600086	东方金钰	3,553,691.08	0.34
11	600600	青岛海尔	3,400,441.05	0.33

12	600300	维维股份	3,190,879.53	0.31
13	600251	冠农股份	3,169,783.21	0.30
14	601928	凤凰传媒	3,041,879.08	0.29
15	600329	中新药业	3,021,313.99	0.29
16	600298	安琪酵母	2,870,930.00	0.28

17	600702	华信股份	2,866,698.64	0.28
18	600138	中青旅	2,543,409.55	0.24
19	600518	金种子酒	2,505,291.31	0.24
20	600518	康美药业	2,427,041.90	0.23

注：1、卖出主要股票二级市场上的主动买入、新股、要约收购、发行人回购及行权等获得的股票，不按照因基
金资产组合内股票卖出成交的总数量计算。

2、“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交均价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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		139,240,725.30
卖出股票收入（成交）总额		143,810,936.28

注：1、买入股票基金一级市场上主动的买入、新股、配股、要约收购、及行权等获得的股票，卖出主要股票二级市场上市
主动的卖出、新股、配股、要约收购、及行权等获得的股票，买入/卖出所有不通过证券交易所的基金品种的基金组
合的买入/卖出金额。

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买入/卖出成交金额（成交均价乘以成交数量）填
列，不考虑相关交易费用。

3.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未有债券。

3.6 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
本基金本报告期末未有债券。

3.7 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有资产支持证券。

3.8 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有贵金属。

3.9 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有权证。

3.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10.1.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未有股指期货合约。

10.1.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，本基金不保与股指期货交易。

10.1.1 报告期末本基金投资的国债期货交易情况

10.1.1.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

10.1.2 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有国债期货合约。

10.1.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同约定，本基金不参与国债期货交易。

10.2 投资组合报告

10.2.1 报告期末基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责的情形。

10.2.2 报告期末基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须库内买入。

10.2.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

无人认领票类(成交)总额	名称	金额
1	存出保证金	16,668.04
2	应收存透支罚款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	818.20
5	应收申购款	--
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	17,486.24

R.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。

R.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

R.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

§9 基金份额持有人信息							份额单位:份
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	占总体 份额比例	持有份额	占总体 份额比例	持有份额	占总体 份额比例
901	197,926.25	169,477,683.00	95.04%	8,853,387.00	4.96%	167,255,483.00	93.78%

序号	持有人名称	持有股份(股)	占上市股份总比例
1	国都证券-工商银行-国都安仁得利集合资产管理计划	787,000.00	0.47%
2	大信汇基亚集团有限公司	699,150.00	0.34%
3	新华人寿保险股份有限公司-万能-得意财富账户-基金账户	538,000.00	0.30%
4	李瑞琦	329,575.00	0.18%
5	李瑞琦	325,075.00	0.18%
6	陆慧吉	250,746.00	0.14%
7	潘斌	142,400.00	0.08%
8	曹振光	126,600.00	0.07%
9	徐泽易	123,151.00	0.07%
10	李晋	121,853.00	0.07%
11	中国工商银行-招商上证消费80交易型开放式指数证券投资	167,255,483.00	93.79%

报告期内持有者为除保险、证券消费90ETF联接基金以外的前十名持有人。	
9.2 期末基金管理人从业人员的持有本基金的情况	
本报告期末基金管理人从业人员的持有本基金。	
9.4 期末基金管理人从业人员的持有本基金基金份额总额情况	
序号	持有基金份额总额数量(万股)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人员持有	0
本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

	单位:份
基金合同生效日(2010年12月8日)基金份额总额	685,530,280.00
本报告期初基金份额总额	384,331,550.00
本报告基金总申购份额	100,800,000.00
减:本报告基金总赎回份额	306,800,000.00
本报告基金总申购份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	178,331,550.00

§ 11 重大事件揭示

1.1 基金份额持有人大会决议

本报告期间没有举行基金份额持有人大会。

1.2 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.根据基金管理人2014年3月25日的公告,恒利基金基金管理有限公司第四届董事会2014年第一次会议审议通过,因工作变动,赵永春先生不再担任公司副总经理,全利恒(北京)基金管理有限公司全资子公司恒利财富资产管理有限公司

总经理职务。

2、根据本基金管理人2014年12月30日的公告,招商基金管理有限公司第四届董事会2014年第四次决议审议通过,同意由一凡先生担任公司副总经理职务。

3、根据本基金管理人2015年1月7日的公告,招商基金管理有限公司第四届董事会2015年第一次会议审议通过,同意由小林先生担任公司总经理职务,全职担任招商财富资产管理有限公司董事长,公司总经理职务由公司董事长张光先生担任。

4、根据本基金管理人2015年3月12日的公告,招商基金第四届董事会2015年第三次会议审议通过,本基金管理人于2015年3月12日聘任王宇先生为副总经理,经各方同意,王宇先生担任本基金管理人副总经理职务,负责本基金管理人日常运营管理工作。

[illegible]

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 成交总金额的比率	佣金	占当期佣金 总量的比率		
平安证券	1	283,034,799.48	100.00%	257,674.27	100.00%	-	
中信建投	1	-	-	-	-	-	
交通银行	1	-	-	-	-	-	

基金交易佣金根据券商的年度综合评估结果进行分配,券商综合评估根据研究报告质量、路演质量、联合调研等问题以服务质量为权重分配,从多家服务券商中选取符合法律法规及经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配,季度评估和佣金分配由专人负责。

17.7.2 基金佣金证券公司业务单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		债券回购交易		权益交易	
	成交金额	占当期债券成交总金额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总金额的比例	成交金额	占当期权益成交总金额的比例
平安证券	1,314,102.10	100.00%	--	--	--	--
中信建投	--	--	--	--	--	--

齐鲁证券	--	--	--	--	--	--
------	----	----	----	----	----	----

招商基金管理有限公司
2015年3月27日
