

2016年3月28日 星期一 | B163

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	300058	蓝色光标	254,963,572.61	13.20
2	300147	香雪制药	248,332,430.97	12.95
3	300043	互动娱乐	214,925,182.57	11.18
4	600660	福耀玻璃	207,574,157.21	10.61
5	600563	法拉电子	170,116,652.49	8.85
6	601318	中国平安	159,587,407.94	8.30

年度 村

9	000100	TCL 集团	125,503,665.66	6.53
10	600773	湘钢股份	122,125,760.00	6.36

8	000211	若 祥 股	138,732,006.54	700
9	000100	TCL 集团	128,503,666.66	686
10	000772	西藏城投	122,175,783.09	628
11	002108	沧州明珠	121,156,104.36	630
12	600066	海信电器	116,094,327.72	604
13	300070	碧水源	112,676,136.11	587
14	000278	人福医药	106,238,465.02	647
15	000783	凤凰传媒	104,694,285.10	541
16	600223	鲁商置业	102,366,179.68	525
17	600198	大唐电信	101,567,808.07	528

18	000559	万向钱潮	94,560,732.86	4.92
----	--------	------	---------------	------

18	000666	万润科技	94,560,732.96	4.92
19	600697	信达地产	94,138,816.13	4.50
20	002321	海大集团	92,196,177.03	4.79
21	002104	恒宝股份	92,006,093.20	4.78
22	600617	国新能源	89,678,133.64	4.73
23	600483	福能股份	87,644,685.08	4.56
24	002688	史丹利	86,291,074.97	4.43
25	300326	三六五网	83,319,692.22	4.28
26	002528	新都化工	80,775,348.08	4.20
27	002410	广联达	76,534,929.88	3.97
28	002470	金正大	72,521,846.09	3.77
29	603985	宏发股份	72,424,740.42	3.77
30	600388	龙净环保	72,228,769.92	3.76
31	002436	兴森科技	69,814,583.51	3.63
32	601985	中国核电	67,004,446.69	3.48
33	000613	顺鑫集团	60,849,810.69	3.16
34	002433	太安堂	59,897,226.34	3.11
35	600031	三一重工	58,292,761.71	3.03
36	300041	回天新材	58,199,616.17	3.03

37	000269	北京港	68,187,172.84	3.03
38	601727	上海电气	57,776,266.81	3.03
39	000296	广药集团	57,648,133.00	3.03
40	000454	松芝股份	54,916,626.02	3.03
41	002117	东港股份	56,953,531.52	2.90
42	601088	中国银行	56,877,456.73	2.91
43	600090	长江电力	56,424,656.20	2.88
44	601106	中信特钢	54,679,424.18	2.94
45	300367	东方雨虹	54,162,243.96	2.82
46	600401	江铃集团	54,144,107.01	2.82

47	300202	曙光科技	53,894,000.00	2.80
48	601668	中国铁建	53,680,046.95	2.70
49	601212	山东路桥	52,257,307.48	2.77
50	600611	国药股份	52,022,224.88	2.71
51	002486	晖生股份	51,664,060.76	2.68
52	600679	天华津	51,548,088.23	2.68
53	300364	中文传媒	50,840,119.20	2.64
54	002768	中国铁物	50,629,572.22	2.62
55	600895	信达地产	49,717,638.66	2.59
56	002642	荣之联	49,264,263.61	2.56

57	300126	汇川技术	48,790,614.69	2.54
58	603798	普源精微	48,541,892.78	2.52
59	600466	中国西电	46,267,450.12	2.41
60	600470	六国化工	36,329,000.34	2.30
61	600109	国金证券	45,879,885.98	2.41
62	600688	用友网络	44,180,976.51	2.35
63	000671	创世纪	44,749,525.53	2.32
64	601231	福耀集团	41,235,347.76	2.25
65	000069	华侨城A	42,267,735.89	2.30
66	600270	外运发展	41,940,040.04	2.18
67	000625	长安汽车	41,600,677.10	2.16
68	300123	华海药业	38,485,342.17	2.02
69	002229	富祥药业	38,702,100.10	2.02

70	000150	宜华健康	38,616,107.11	2.01
----	--------	------	---------------	------

70	000150	宜华健康	38,616,107.11	2.01
----	--------	------	---------------	------

注：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。B4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	6,544,705,969.74
卖出股票的收入（成交）总额	7,203,198,023.22

注：买入股票成本、卖出股票收入均按实际成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	120,213,000.00	4.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,034,000.00	1.52
	其中：政策性金融债	40,034,000.00	1.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-	-
8	商业存单	-	-	-
9	其他	-	-	-
10	合计	160,247,000.00	-	6.07

8.6 根据公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 10 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(%)	
1	019569	15国信09	500,000	50,110,000.000	1.90
2	150015	15附息国债15	500,000	50,065,000.000	1.90
3	150215	15国开15	300,000	30,039,000.000	1.14
4	019560	15国信06	200,000	20,049,000.000	0.78
5	110225	11国开25	100,000	9,996,000.000	0.36

8.7 根据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

本基金未持有资产支持证券。

8.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前 5 名贵金属投资明细

本基金未持有贵金属。

8.9 期末公允价值与基金资产净值比例大小前五名的权证投资说明
本基金期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金持有的股指期货情况说明
8.10.1 报告期末本基金持有的股指期货持仓和损益明细
本基金期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资策略
本基金管理人将按照中国金融期货交易所《股指期货业务细则》、《股指期货投资者适当性制度》等有关规定，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要是运用多头、空头股指期货合约。

8.10.3 本基金投资股指期货的投资情况
本基金报告期内未投资股指期货，持仓情况和损益情况均为无。

8.11 本基金投资国债期货的投资策略
本基金管理人将按照中国金融期货交易所《国债期货业务细则》、《国债期货投资者适当性制度》等有关规定，以套期保值为主要目的，有选择地投资于国债期货。套期保值将主要是运用多头、空头国债期货合约。

8.11.1 报告期末本基金持有的国债期货持仓和损益明细
本基金报告期内未投资国债期货，持仓情况和损益情况均为无。

8.11.2 本基金投资国债期货的投资策略
本基金管理人将按照中国金融期货交易所《国债期货业务细则》、《国债期货投资者适当性制度》等有关规定，以套期保值为主要目的，有选择地投资于国债期货。套期保值将主要是运用多头、空头国债期货合约。

8.11.3 本基金投资国债期货的投资情况
本基金报告期内未投资国债期货，持仓情况和损益情况均为无。

法律法规对基金投资品种和比例限制中投资组合另有规定的，本基金将按照法律法规的规定执行。

R.1.7 除按照《基金合同》约定的估值原则和方法进行估值外，本基金将采用市场公认的更具权威的估值机构本基金的基金合约。本基金不投资于衍生品。

R.1.8 投资组合报告周期

R.12.1 本报告期本基金投资组合的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或没有编制虚假财务报告，也没有受到公开谴责、处罚的情况。

R.12.2 本报告期本基金前十名股票中，没有持有与本基金合同约定投资范围之外的情况。

R.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	1,390,622.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,398,003.80
5	应收申购款	110,743,289.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	114,531,946.57

R.12.4 期末按公允价值计量的投资组合成本明细表
本基金本报告期末持仓中有待摊费用

R.12.5 期末前十名股票中存在受质押情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股东名称	流通受限股份的数量(股)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300943	互动健康	85,160,000	3.26	重大事项
2	300025	华创股份	70,266,000	2.89	重大事项

9.9 基金份额持有人集中度

9.1 期末基金份额持有人户数及持有基金份额情况

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	占份额比例	持有份额	占份额比例
40,488	30,494.46	951,430,320.32	58.02%	696,219,694.29	41.10%

9.2 期末基金资产中投资于具有基金托管人资格

项目	持有份额总额(元)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	249,429.76	0.02%

9.3 期末基金资产中投资于持有开放式基金基金份额区间的情况

项目	持有基金份额总数的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门职员持有开放式基金	0
本基金基金经理持有开放式基金	0

9.10 开放式基金资产变动

基金合同生效日(2002年8月6日)基金份额总额	2,226,366,461.60
本报告期初基金份额总额	1,613,101,876.05
本报告期基金总申购份额	1,402,462,133.71

减:本报告期基金总赎回份额	1,488,203,496.55
---------------	------------------

[illegible]

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

11.7基金运用证券交易产生的相关数据						金额单位：人民币元
券商名称	交易单元数量	股票交易额		应支付券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金金额	占当期佣金 总额的百分比	
广州证券	1	--	--	--	--	--
华融证券	1	--	--	--	--	--
申万宏源	1	5,396,098,457.28	39.29%	4,983,314,440.31	39.31%	--
兴业证券	1	1,790,643,461.04	13.04%	1,640,630,009	12.62%	--
中国银河	1	1,626,207,742.46	11.84%	1,564,564,562	11.92%	--
信达证券	1	1,569,001,163.34	11.42%	1,428,762,925.9	11.02%	--
平安证券	1	911,861,693.71	6.64%	831,560,118	6.59%	--
中金公司	1	834,516,406.16	6.08%	763,908,669	6.06%	--
银河证券	1	812,007,699.06	5.91%	756,236,411	5.9%	--
国泰君安	2	703,367,791.33	5.78%	729,625,211	5.78%	--

注：基金资产原值的选择标准是：

- (1) 资产规模、经营业绩；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，无向单一客户进行大额定向资产管理；
- (4) 内部管理规范，具备健全的风险控制，开展基金业务具有高度透明的操作；
- (5) 基金管理人拥有良好声誉，全部资产均能符合中国证监会规定的有关基金法律法规的要求；行业发展趋势及证券市场走向，个股分析数据以及基金主要持仓股票，根据基金投资标的的认定要求，提供有10项支持。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

[illegible]

的规定)及《国泰金鹰增长证券投资基金基金合同》的约定,本基金自2015年8月8日起基金类别变更为混合型基金,基金名称由“国泰金鹰增长证券投资基金”修改为“国泰金鹰增长混合型证券投资基金”,基金合同部分条款相应修订。具体请查阅本公司于2015年7月23日

的规定)及《国泰金鹰增长证券投资基金基金合同》的约定,本基金自2015年8月8日起基金类别变更为混合型基金,基金名称由“国泰金鹰增长证券投资基金”修改为“国泰金鹰增长混合型证券投资基金”,基金合同部分条款相应修订。具体请查阅本公司于2015年7月23日