

# 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

## 2014 年半年度报告

2014 年 6 月 30 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2014 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

### 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	11
<b>§6 半年度财务会计报告 (未经审计) .....</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表 .....	11
6.2 利润表 .....	12
6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表 .....	13
6.4 报表附注 .....	15
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	32
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	40
7.6 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 .....	41
7.7 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 .....	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	41
7.9 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 .....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	44
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
10.2 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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)
基金简称	兴全沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	兴全 300
基金主代码	163407
前端交易代码	163407
后端交易代码	163408
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2010 年 11 月 2 日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,412,039,457.53 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-01-19

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业全球基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	李芳菲
	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	Lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95599
传真		021-20398858	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		200122	100031
法定代表人		兰荣	蒋超良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyfunds.com.cn">http://www.xyfunds.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014 年 1 月 1 日 - 2014 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-1, 516, 581. 42
本期利润	-52, 084, 296. 34
加权平均基金份额本期利润	-0. 0401

本期加权平均净值利润率	-5.25%
本期基金份额净值增长率	-4.96%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
期末可供分配利润	-331,874,715.76
期末可供分配基金份额利润	-0.2350
期末基金资产净值	1,080,164,741.77
期末基金份额净值	0.7650
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2014年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	-23.50%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.99%	0.74%	0.39%	0.74%	0.60%	0.00%
过去三个月	1.46%	0.88%	0.85%	0.83%	0.61%	0.05%
过去六个月	-4.96%	1.02%	-6.69%	0.99%	1.73%	0.03%
过去一年	3.20%	1.15%	-1.42%	1.11%	4.62%	0.04%
过去三年	-19.93%	1.23%	-27.36%	1.23%	7.43%	0.00%
自基金合同生效起至今	-23.50%	1.18%	-35.85%	1.24%	12.35%	-0.06%

注：本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是沪深 300 指数，本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

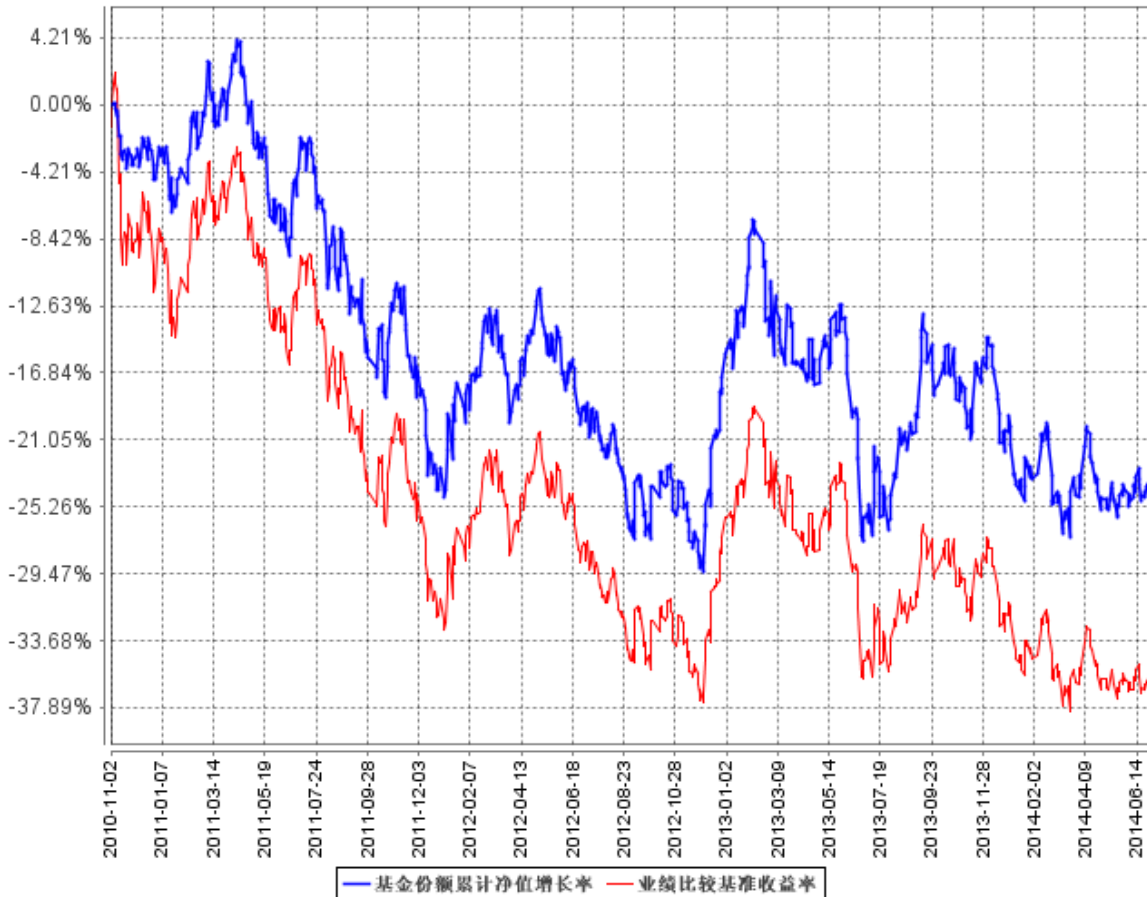
$$\text{Return}_t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2014 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 2 日至 2011 年 5 月 1 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业全球基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经证监基金字[2003] 100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月 2 日，中国证监会批准（证监许可[2008]6 号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为



公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”，公司注册资本由 9800 万元变更为 1.2 亿元人民币。2008 年 7 月 7 日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币 1.2 亿元变更为人民币 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。

截止 2014 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十四只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、兴全绿色投资股票型证券投资基金 (LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金 (LOF)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金 (LOF)、兴全添利宝货币市场基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申庆	本基金基金经理	2010 年 11 月 2 日	-	17 年	1974 年生，工商管理硕士，历任兴业全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势证券投资基金 (LOF) 基金经理助理、基金管理部总监助理。

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺



或损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金总体坚持既定的资产配置策略，提升了低估值板块的配置，并适度增加了低溢价率转债的投资。行业内的资产配置也不断进行优化，增加了消费类投资比重，基金组合的分红水平显著超过标的指数。上半年沪深 300 指数快速下跌后在低位持续震荡，扣除分红因素后的表现依旧落后于多数其他指数。本基金上半年虽有超额收益，但收益水平依然受制于标的指数的表现。本基金将在不断扩展自身能力圈的前提下，在能力圈范畴内顺应市场的发展、把握市场机遇。将持续风险控制前提下的收益提升作为首要任务。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率-4.96%，同期业绩比较基准收益率-6.69%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014 年 6 月份 PMI 已经连续第 4 个月回升，创下了年内新高，达到了 51.0%。这表明经济内生动力增强。但企业整体盈利水平与投资者预期的改善可能会有所滞后。海外市场变化也需密切关注，欧洲市场持续表现不佳会拖累全球和中国市场的复苏。

2013 年以来，市场存量博弈过程中的成长型、主题型投资良好的盈利水平让很多投资者继续“路径依赖”。小市值板块的依然是市场的“吸金池”。但我们也要看到市场演绎的成长型与主题型投资开始出现明显分化，缺乏估值支撑的市场热点范围在缩小，对应的投资标的更加稀缺，

新热点板块对市场的整体带动效应在弱化。另一方面沪深 300、上证 50 等蓝筹板块相对于往年的分红水平又有显著提高，但股票估值依旧在低位徘徊。如果经济复苏与企业整体盈利预期进一步改善，且新股持续发行后对市场估值影响的累积效应，市场资金可能会逐步主动回撤到低估值板块。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经验，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—XX 基金管理有限公司 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必

要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，兴业全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，兴业全球基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	23,267,034.15	22,528,726.99
结算备付金		277,990.58	343,845.26
存出保证金		61,199.86	288,617.48
交易性金融资产	6.4.7.2	1,008,588,917.73	1,081,200,388.49
其中：股票投资		959,311,809.84	1,026,841,115.49
基金投资		-	-
债券投资		49,277,107.89	54,359,273.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	38,715,331.93

应收利息	6.4.7.5	1,391,710.70	1,029,133.60
应收股利		-	-
应收申购款		100,100,764.72	120,898.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,133,687,617.74	1,144,226,942.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		29,699,755.45	19,799,870.10
应付证券清算款		21,935,054.86	-
应付赎回款		787,738.00	1,167,179.20
应付管理人报酬		639,616.34	793,985.51
应付托管费		119,928.04	148,872.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	89,193.86	237,724.82
应交税费		-	-
应付利息		3,499.13	1,779.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	248,090.29	454,950.18
负债合计		53,522,875.97	22,604,361.24
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,412,039,457.53	1,393,516,681.59
未分配利润	6.4.7.10	-331,874,715.76	-271,894,100.74
所有者权益合计		1,080,164,741.77	1,121,622,580.85
负债和所有者权益总计		1,133,687,617.74	1,144,226,942.09

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7650 元，基金份额总额 1,412,039,457.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年6月30日
<b>一、收入</b>		-46,657,779.16	-164,457,870.31
1.利息收入		917,738.72	904,680.76

其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,432.57	70,267.74
债券利息收入		884,413.23	775,738.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,892.92	58,674.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,899,387.77	-10,070,204.19
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-9,013,839.49	-26,841,281.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-120,541.47	671,877.81
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	12,033,768.73	16,099,199.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-50,567,714.92	-155,388,157.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	92,809.27	95,810.24
<b>减：二、费用</b>		5,426,517.18	7,070,810.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,936,546.87	5,192,882.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	738,102.52	973,665.53
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	336,580.71	455,354.01
5. 利息支出		118,281.81	132,663.37
其中：卖出回购金融资产支出		118,281.81	132,663.37
6. 其他费用	6.4.7.19	297,005.27	316,244.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-52,084,296.34	-171,528,680.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-52,084,296.34	-171,528,680.95

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,393,516,681.59	-271,894,100.74	1,121,622,580.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-52,084,296.34	-52,084,296.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	18,522,775.94	-7,896,318.68	10,626,457.26
其中：1.基金申购款	228,479,091.20	-54,767,173.88	173,711,917.32
2.基金赎回款	-209,956,315.26	46,870,855.20	-163,085,460.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,412,039,457.53	-331,874,715.76	1,080,164,741.77
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,505,704,912.09	-234,701,632.28	1,271,003,279.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-171,528,680.95	-171,528,680.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	35,663,894.12	7,470,356.96	43,134,251.08
其中：1.基金申购款	266,145,348.30	-28,665,646.51	237,479,701.79
2.基金赎回款	-230,481,454.18	36,136,003.47	-194,345,450.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,541,368,806.21	-398,759,956.27	1,142,608,849.94

报表附注为财务报表的组成部分。



本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

<u>          兰荣          </u>	<u>          杨东          </u>	<u>          詹鸿飞          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原名兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金) (以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 证监许可 [2010]1068 号文的核准, 由基金管理人兴业全球基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于 2010 年 11 月 2 日正式生效, 首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人为及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司, 基金托管人为中国农业银行股份有限公司。兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 于 2011 年 1 月 1 日更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”) 编制, 同时, 对于在具体会计核算和信息披露方面, 也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。



### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	23,267,034.15
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	23,267,034.15

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,186,038,696.90	959,311,809.84	-226,726,887.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,241,673.97	9,251,107.89
	银行间市场	39,836,750.00	40,026,000.00
	合计	49,078,423.97	49,277,107.89
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,235,117,120.87	1,008,588,917.73	-226,528,203.14

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,110.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	125.10
应收债券利息	1,390,447.66
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	27.50
合计	1,391,710.70

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	87,502.58
银行间市场应付交易费用	1,691.28
合计	89,193.86

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,119.62
预提费用	193,396.69
指数使用费	39,023.33
其他	14,550.65
合计	248,090.29

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,393,516,681.59	1,393,516,681.59
本期申购	228,479,091.20	228,479,091.20
本期赎回(以“-”号填列)	-209,956,315.26	-209,956,315.26
本期末	1,412,039,457.53	1,412,039,457.53

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-198,713,742.39	-73,180,358.35	-271,894,100.74
本期利润	-1,516,581.42	-50,567,714.92	-52,084,296.34

本期基金份额交易产生的变动数	-2,435,376.90	-5,460,941.78	-7,896,318.68
其中：基金申购款	-33,272,605.58	-21,494,568.30	-54,767,173.88
基金赎回款	30,837,228.68	16,033,626.52	46,870,855.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-202,665,700.71	-129,209,015.05	-331,874,715.76

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	20,253.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,832.01
其他	1,346.62
合计	23,432.57

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	129,733,399.82
减：卖出股票成本总额	138,747,239.31
买卖股票差价收入	-9,013,839.49

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	53,426,141.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,460,682.90
减：应收利息总额	1,086,000.41
债券投资收益	-120,541.47

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,033,768.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,033,768.73

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1. 交易性金融资产	-50,567,714.92
——股票投资	-51,009,862.56
——债券投资	442,147.64
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-50,567,714.92

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	80,157.11
转换费收入	12,652.16
合计	92,809.27

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	335,505.71
银行间市场交易费用	1,075.00
合计	336,580.71

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	143,808.12
账户维护费用	9,400.00
银行费用	5,185.25
指数使用费	89,023.33
合计	297,005.27

#### 6.4.7.20 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴业全球基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日



	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
兴业证券	109,410,605.39	44.33%	342,729,266.61	94.28%

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	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 成交总额的 比例
兴业证券	2,194,702.66	11.42%	11,018,248.00	100.00%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
兴业证券	5,200,000.00	3.50%	196,900,000.00	91.28%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
兴业证券	77,800.52	44.35%	27,350.67	31.26%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
兴业证券	242,112.30	94.25%	108,354.54	88.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,936,546.87	5,192,882.93
其中：支付销售机构的客户维护费	1,179,304.96	1,604,036.18

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.8%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	738,102.52	973,665.53

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.15%/当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	23,267,034.15	20,253.94	24,447,672.80	66,155.52

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601888	中国国旅	2013年7月17日	2014年7月15日	非公开发行流通受限	26.58	32.76	200,000	5,316,000.00	6,552,000.00	1
000100	TCL集团	2014年4月29日	2015年4月30日	非公开发行流通受限	2.18	2.20	1,700,000	3,706,000.00	3,740,000.00	-
000721	西安饮食	2013年7月5日	2014年7月10日	非公开发行流通受限	5.21	4.86	300,000	1,563,000.00	1,458,000.00	2
000721	西安饮食	2014年4月28日	2014年7月10日	非公开发行转增	-	4.86	300,000	-	1,458,000.00	-
002310	东方园林	2013年12月16日	2014年12月18日	非公开发行流通受限	25.00	16.51	56,200	1,405,000.00	927,862.00	3
002310	东方园林	2014年6月23日	2014年12月18日	非公开发行转增	-	16.51	28,100	-	463,931.00	-
603328	依顿电子	2014年6月23日	2014年7月1日	新股流通受限	15.31	15.31	1,000	15,310.00	15,310.00	-
002727	一心堂	2014年6月25日	2014年7月2日	新股流通受限	12.20	12.20	500	6,100.00	6,100.00	-

- 注：1. 本基金持有的非公开发行股票中国国旅，于 2014 年 6 月 24 日实施 2013 年年度利润分配，向全体股东按每 10 股派 4.00 元（含税）。
2. 本基金持有的非公开发行股票西安饮食，于 2014 年 4 月 28 日实施 2013 年年度利润分配，向全体股东按每 10 股送红股 3.40 股，派 0.85 元（含税），同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 6.60 股。本基金新增 300,000 股。
3. 本基金持有的非公开发行股票东方园林，于 2014 年 6 月 23 日实施 2013 年年度利润分配，向全体股东按每 10 股派 1.20 元（含税），同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5.00 股。本基金新增 28,100.00 股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600832	东方明珠	2014年5月29日	重大事项停牌	10.98	-	-	310,000	2,326,762.49	3,403,800.00	-
601669	中国电建	2014年5月13日	重大事项停牌	2.79	-	-	978,017	3,121,641.93	2,728,667.43	-
600516	方大炭素	2014年6月30日	临时停牌	9.59	2014年7月2日	9.05	145,965	1,514,026.37	1,399,804.35	-
600775	南京熊猫	2014年4月11日	重大资产重组	9.31	2014年7月16日	9.32	110,000	561,000.00	1,024,100.00	-
600498	烽火通信	2014年6月30日	重大事项停牌	11.91	2014年7月7日	12.10	57,086	878,907.88	679,894.26	-
000878	云南铜业	2014年4月17日	重大事项停牌	7.61	2014年7月17日	7.50	81,213	1,289,310.38	618,030.93	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 29,699,755.45 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
130236	13 国开 36	2014 年 7 月 2 日	100.02	100,000	10,002,000.00
130243	13 国开 43	2014 年 7 月 2 日	100.11	200,000	20,022,000.00
合计				300,000	30,024,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本

基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	23,267,034.15	-	-	-	-	-	23,267,034.15
结算备付金	277,990.58	-	-	-	-	-	277,990.58
存出保证金	61,199.86	-	-	-	-	-	61,199.86
交易性金融资产	-20,004,000.00	20,022,000.00	9,078,559.60	172,548.29	959,311,809.84	1,008,588,917.73	
应收利息	-	-	-	-	-	1,391,710.70	1,391,710.70
应收申购款	100,003,080.91	-	-	-	-	97,683.81	100,100,764.72
资产总计	123,609,305.50	20,004,000.00	20,022,000.00	9,078,559.60	172,548.29	960,801,204.35	1,133,687,617.74
负债							
卖出回购金融资产款	29,699,755.45	-	-	-	-	-	29,699,755.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-	21,935,054.86	21,935,054.86
应付赎回款	-	-	-	-	-	787,738.00	787,738.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	639,616.34	639,616.34
应付托管费	-	-	-	-	-	119,928.04	119,928.04
应付交易费用	-	-	-	-	-	89,193.86	89,193.86
应付利息	-	-	-	-	-	3,499.13	3,499.13
其他负债	-	-	-	-	-	248,090.29	248,090.29

负债总计	29,699,755.45	-	-	-	-	23,823,120.52	53,522,875.97
利率敏感度缺口	93,909,550.05	20,004,000.00	20,022,000.00	9,078,559.60	172,548.29	936,978,083.83	1,080,164,741.77
上年度末 2013 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,528,726.99	-	-	-	-	-	22,528,726.99
结算备付金	343,845.26	-	-	-	-	-	343,845.26
存出保证金	288,617.48	-	-	-	-	-	288,617.48
交易性金融资产	29,985,000.00	-	9,944,000.00	9,412,516.90	5,017,756.10	1,026,841,115.49	1,081,200,388.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	38,715,331.93	38,715,331.93
应收利息	-	-	-	-	-	1,029,133.60	1,029,133.60
应收申购款	9,831.52	-	-	-	-	111,066.82	120,898.34
资产总计	53,156,021.25	-	9,944,000.00	9,412,516.90	5,017,756.10	1,066,696,647.84	1,144,226,942.09
负债							
卖出回购金融资产款	19,799,870.10	-	-	-	-	-	19,799,870.10
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,167,179.20	1,167,179.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	793,985.51	793,985.51
应付托管费	-	-	-	-	-	148,872.29	148,872.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	237,724.82	237,724.82
应付利息	-	-	-	-	-	1,779.14	1,779.14
其他负债	-	-	-	-	-	454,950.18	454,950.18
负债总计	19,799,870.10	-	-	-	-	2,804,491.14	22,604,361.24
利率敏感度缺口	33,356,151.15	-	9,944,000.00	9,412,516.90	5,017,756.10	1,063,892,156.70	1,121,622,580.85

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2014 年 6 月 30 日）	上年度末（2013 年 12 月 31 日）
	利率 +1%	-95,225.12	-41,029.35



利率 -1%	95,725.97	41,190.71
--------	-----------	-----------

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日		上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	959,311,809.84	88.81	1,026,841,115.49	91.55
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	49,277,107.89	4.56	54,359,273.00	4.85
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,008,588,917.73	93.37	1,081,200,388.49	96.40

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2014 年 6 月 30 日)	上年度末 (2013 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准 -10%	-103, 248, 220. 60	-112, 485, 292. 53
	业绩比较基准 +10%	103, 248, 220. 60	112, 485, 292. 53

注: 本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析, 反映了在其他变量不变的假设下, 证券投资价格发生合理、可能的变动时, 将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	959, 311, 809. 84	84. 62
	其中: 股票	959, 311, 809. 84	84. 62
2	固定收益投资	49, 277, 107. 89	4. 35
	其中: 债券	49, 277, 107. 89	4. 35
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	23, 545, 024. 73	2. 08
7	其他各项资产	101, 553, 675. 28	8. 96
8	合计	1, 133, 687, 617. 74	100. 00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	212,413.30	0.02
B	采矿业	65,891,901.86	6.10
C	制造业	285,401,677.24	26.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,430,569.90	2.54
E	建筑业	36,273,603.24	3.36
F	批发和零售业	25,506,625.76	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	20,563,521.95	1.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,602,998.54	1.17
J	金融业	361,266,077.69	33.45
K	房地产业	46,668,552.68	4.32
L	租赁和商务服务业	9,576,299.03	0.89
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,859,443.59	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,280,478.68	0.30
S	综合	1,914,407.16	0.18
	合计	903,448,570.62	83.64

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	126,627.42	0.01
C	制造业	29,337,571.80	2.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,825,600.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	2,916,000.00	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	21,657,440.00	2.01

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,863,239.22	5.17

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	1,537,663	60,491,662.42	5.60
2	600036	招商银行	4,175,700	42,759,168.00	3.96
3	600000	浦发银行	3,823,700	34,604,485.00	3.20
4	600016	民生银行	5,570,600	34,593,426.00	3.20
5	601166	兴业银行	3,181,600	31,911,448.00	2.95
6	000895	双汇发展	890,400	31,867,416.00	2.95
7	601328	交通银行	5,852,000	22,705,760.00	2.10
8	000002	万科 A	2,222,900	18,383,383.00	1.70
9	601088	中国神华	1,214,100	17,653,014.00	1.63
10	600104	上汽集团	1,115,700	17,070,210.00	1.58
11	601601	中国太保	940,324	16,728,363.96	1.55
12	600030	中信证券	1,419,800	16,270,908.00	1.51
13	600741	华域汽车	1,650,307	16,140,002.46	1.49
14	600664	哈药股份	2,474,796	15,393,231.12	1.43
15	600837	海通证券	1,469,787	13,448,551.05	1.25
16	000001	平安银行	1,143,884	11,335,890.44	1.05
17	601006	大秦铁路	1,731,966	10,928,705.46	1.01
18	600690	青岛海尔	709,900	10,478,124.00	0.97
19	601169	北京银行	1,283,420	10,344,365.20	0.96
20	601818	光大银行	3,969,790	10,083,266.60	0.93
21	601668	中国建筑	3,426,340	9,662,278.80	0.89
22	000800	一汽轿车	900,500	8,644,800.00	0.80
23	601939	建设银行	2,028,507	8,377,733.91	0.78

24	600383	金地集团	933,200	8,296,148.00	0.77
25	600519	贵州茅台	56,900	8,078,662.00	0.75
26	600216	浙江医药	877,987	8,033,581.05	0.74
27	600015	华夏银行	940,170	7,709,394.00	0.71
28	600900	长江电力	1,216,800	7,568,496.00	0.70
29	000858	五粮液	400,600	7,182,758.00	0.66
30	600062	华润双鹤	417,324	7,173,799.56	0.66
31	600050	中国联通	2,214,641	7,153,290.43	0.66
32	000100	TCL 集团	3,167,100	7,084,988.00	0.66
33	002024	苏宁云商	1,013,888	6,651,105.28	0.62
34	600048	保利地产	1,321,308	6,553,687.68	0.61
35	601888	中国国旅	200,000	6,552,000.00	0.61
36	601666	平煤股份	1,600,038	6,464,153.52	0.60
37	601009	南京银行	801,022	6,408,176.00	0.59
38	601989	中国重工	1,293,300	6,233,706.00	0.58
39	600795	国电电力	2,870,100	6,228,117.00	0.58
40	600123	兰花科创	818,500	6,155,120.00	0.57
41	601857	中国石油	788,869	5,948,072.26	0.55
42	000063	中兴通讯	443,726	5,821,685.12	0.54
43	000729	燕京啤酒	869,000	5,648,500.00	0.52
44	600089	特变电工	655,800	5,567,742.00	0.52
45	601766	中国南车	1,186,718	5,340,231.00	0.49
46	600600	青岛啤酒	127,400	5,103,644.00	0.47
47	600276	恒瑞医药	149,096	4,944,023.36	0.46
48	601607	上海医药	397,570	4,941,795.10	0.46
49	600028	中国石化	930,000	4,901,100.00	0.45
50	000625	长安汽车	394,600	4,857,526.00	0.45
51	600011	华能国际	852,720	4,826,395.20	0.45
52	000792	盐湖股份	317,400	4,783,218.00	0.44
53	600546	山煤国际	1,315,400	4,709,132.00	0.44
54	600019	宝钢股份	1,125,900	4,616,190.00	0.43
55	600309	万华化学	299,910	4,546,635.60	0.42
56	600585	海螺水泥	283,532	4,457,123.04	0.41
57	601186	中国铁建	963,630	4,442,334.30	0.41
58	601628	中国人寿	318,430	4,333,832.30	0.40
59	600660	福耀玻璃	514,900	4,325,160.00	0.40
60	601688	华泰证券	575,000	4,324,000.00	0.40
61	002142	宁波银行	444,200	4,086,640.00	0.38

62	601299	中国北车	899,813	4,085,151.02	0.38
63	601390	中国中铁	1,521,301	3,924,956.58	0.36
64	000581	威孚高科	136,900	3,692,193.00	0.34
65	601336	新华保险	172,451	3,643,889.63	0.34
66	000338	潍柴动力	202,857	3,608,826.03	0.33
67	000069	华侨城 A	736,811	3,455,643.59	0.32
68	000157	中联重科	778,271	3,447,740.53	0.32
69	601988	中国银行	1,346,600	3,433,830.00	0.32
70	600832	东方明珠	310,000	3,403,800.00	0.32
71	600873	梅花生物	646,947	3,318,838.11	0.31
72	000402	金融街	606,214	3,303,866.30	0.31
73	601699	潞安环能	433,788	3,292,450.92	0.30
74	600196	复星医药	159,776	3,225,877.44	0.30
75	601992	金隅股份	563,128	3,164,779.36	0.29
76	600170	上海建工	727,537	3,121,133.73	0.29
77	600352	浙江龙盛	193,210	3,120,341.50	0.29
78	601398	工商银行	901,183	3,055,010.37	0.28
79	601899	紫金矿业	1,392,678	3,036,038.04	0.28
80	601998	中信银行	703,043	3,001,993.61	0.28
81	000024	招商地产	274,332	2,858,539.44	0.26
82	600348	阳泉煤业	497,057	2,803,401.48	0.26
83	601669	中国电建	978,017	2,728,667.43	0.25
84	600009	上海机场	210,183	2,711,360.70	0.25
85	600100	同方股份	293,100	2,611,521.00	0.24
86	600893	航空动力	100,807	2,597,796.39	0.24
87	600674	川投能源	220,847	2,592,743.78	0.24
88	600153	建发股份	453,180	2,469,831.00	0.23
89	600166	福田汽车	483,775	2,467,252.50	0.23
90	600150	中国船舶	116,000	2,442,960.00	0.23
91	000623	吉林敖东	152,100	2,360,592.00	0.22
92	600739	辽宁成大	152,948	2,329,398.04	0.22
93	600177	雅戈尔	317,568	2,232,503.04	0.21
94	000983	西山煤电	420,438	2,215,708.26	0.21
95	601800	中国交建	585,852	2,202,803.52	0.20
96	000937	冀中能源	375,865	2,191,292.95	0.20
97	000061	农产品	232,663	2,147,479.49	0.20
98	600362	江西铜业	164,647	2,020,218.69	0.19
99	000709	河北钢铁	1,080,468	2,009,670.48	0.19

100	601117	中国化学	384,526	2,003,380.46	0.19
101	600642	申能股份	457,347	1,975,739.04	0.18
102	600588	用友软件	140,102	1,971,235.14	0.18
103	600208	新湖中宝	657,286	1,919,275.12	0.18
104	600875	东方电气	160,008	1,899,294.96	0.18
105	000686	东北证券	263,600	1,890,012.00	0.17
106	000999	华润三九	102,190	1,879,274.10	0.17
107	600649	城投控股	296,539	1,868,195.70	0.17
108	000568	泸州老窖	113,811	1,864,224.18	0.17
109	600547	山东黄金	118,600	1,835,928.00	0.17
110	601333	广深铁路	709,952	1,803,278.08	0.17
111	000629	攀钢钒钛	861,569	1,792,063.52	0.17
112	600827	友谊股份	163,025	1,790,014.50	0.17
113	600271	航天信息	85,665	1,787,828.55	0.17
114	601618	中国中冶	1,034,549	1,769,078.79	0.16
115	000876	新希望	155,768	1,758,620.72	0.16
116	601018	宁波港	767,954	1,743,255.58	0.16
117	002081	金螳螂	121,689	1,723,116.24	0.16
118	600839	四川长虹	557,800	1,718,024.00	0.16
119	601898	中煤能源	423,798	1,707,905.94	0.16
120	000728	国元证券	180,400	1,702,976.00	0.16
121	600369	西南证券	198,800	1,699,740.00	0.16
122	600143	金发科技	385,051	1,698,074.91	0.16
123	000776	广发证券	172,424	1,689,755.20	0.16
124	600718	东软集团	123,609	1,667,485.41	0.15
125	601928	凤凰传媒	179,599	1,666,678.72	0.15
126	600655	豫园商城	224,135	1,649,633.60	0.15
127	600376	首开股份	379,042	1,637,461.44	0.15
128	000425	徐工机械	237,038	1,623,710.30	0.15
129	600068	葛洲坝	436,809	1,620,561.39	0.15
130	601098	中南传媒	111,759	1,613,799.96	0.15
131	600252	中恒集团	130,400	1,529,592.00	0.14
132	000778	新兴铸管	410,800	1,524,068.00	0.14
133	601238	广汽集团	200,122	1,506,918.66	0.14
134	000718	苏宁环球	332,300	1,498,673.00	0.14
135	000630	铜陵有色	166,932	1,495,710.72	0.14
136	000039	中集集团	107,706	1,449,722.76	0.13
137	600863	内蒙华电	382,090	1,440,479.30	0.13



138	600516	方大炭素	145,965	1,399,804.35	0.13
139	002310	东方园林	84,300	1,391,793.00	0.13
140	000839	中信国安	178,143	1,353,886.80	0.13
141	600096	云天化	187,466	1,317,885.98	0.12
142	600583	海油工程	174,948	1,289,366.76	0.12
143	000333	美的集团	65,207	1,259,799.24	0.12
144	000401	冀东水泥	154,300	1,254,459.00	0.12
145	601866	中海集运	533,552	1,125,794.72	0.10
146	600157	永泰能源	448,036	1,061,845.32	0.10
147	601111	中国国航	321,083	1,056,363.07	0.10
148	600115	东方航空	441,589	1,020,070.59	0.09
149	601158	重庆水务	198,679	981,474.26	0.09
150	600895	张江高科	149,883	977,237.16	0.09
151	600395	盘江股份	149,000	949,130.00	0.09
152	600256	广汇能源	133,500	937,170.00	0.09
153	000400	许继电气	45,600	914,280.00	0.08
154	600415	小商品城	174,318	876,819.54	0.08
155	600316	洪都航空	50,000	854,500.00	0.08
156	600188	兖州煤业	122,012	844,323.04	0.08
157	601258	庞大集团	176,216	773,588.24	0.07
158	601991	大唐发电	209,900	747,244.00	0.07
159	002051	中工国际	45,840	742,608.00	0.07
160	002007	华兰生物	28,036	731,739.60	0.07
161	600498	烽火通信	57,086	679,894.26	0.06
162	000869	张裕 A	26,352	635,346.72	0.06
163	002673	西部证券	58,500	631,800.00	0.06
164	002001	新和成	50,000	619,500.00	0.06
165	000878	云南铜业	81,213	618,030.93	0.06
166	601139	深圳燃气	91,549	611,547.32	0.06
167	000423	东阿阿胶	17,200	573,104.00	0.05
168	601918	国投新集	200,637	559,777.23	0.05
169	000651	格力电器	18,506	545,001.70	0.05
170	600403	大有能源	101,432	536,575.28	0.05
171	600060	海信电器	50,700	489,255.00	0.05
172	000961	中南建设	74,300	485,179.00	0.04
173	002375	亚厦股份	20,200	455,712.00	0.04
174	600809	山西汾酒	33,711	447,682.08	0.04
175	603000	人民网	11,100	435,009.00	0.04

176	002269	美邦服饰	47,718	396,536.58	0.04
177	000656	金科股份	50,700	349,323.00	0.03
178	601808	中海油服	18,926	332,908.34	0.03
179	601225	陕西煤业	77,900	321,727.00	0.03
180	600118	中国卫星	17,120	316,377.60	0.03
181	000768	中航飞机	30,000	315,900.00	0.03
182	600008	首创股份	50,700	313,326.00	0.03
183	600267	海正药业	20,200	299,566.00	0.03
184	601118	海南橡胶	34,595	212,413.30	0.02
185	000725	京东方 A	91,582	198,732.94	0.02
186	601933	永辉超市	30,400	192,128.00	0.02
187	600029	南方航空	75,625	174,693.75	0.02
188	000598	兴蓉投资	30,400	145,008.00	0.01
189	002065	东华软件	1,098	22,091.76	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	000732	泰禾集团	2,536,000	21,657,440.00	2.01
2	000919	金陵药业	1,147,000	15,966,240.00	1.48
3	000933	神火股份	2,777,177	9,609,032.42	0.89
4	000721	西安饮食	600,000	2,916,000.00	0.27
5	600970	中材国际	277,909	1,895,339.38	0.18
6	600775	南京熊猫	110,000	1,024,100.00	0.09
7	600811	东方集团	170,000	882,300.00	0.08
8	600694	大商股份	20,000	510,600.00	0.05
9	601369	陕鼓动力	77,000	431,970.00	0.04
10	600859	王府井	27,000	426,600.00	0.04
11	601717	郑煤机	77,000	374,220.00	0.03
12	600971	恒源煤电	23,713	126,627.42	0.01
13	603328	依顿电子	1,000	15,310.00	0.00
14	300385	雪浪环境	500	12,830.00	0.00
15	002726	龙大肉食	500	8,530.00	0.00
16	002727	一心堂	500	6,100.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600837	海通证券	10,629,196.00	0.95
2	601318	中国平安	8,654,164.23	0.77
3	000100	TCL 集团	7,892,488.00	0.70
4	601688	华泰证券	4,031,124.64	0.36
5	300017	网宿科技	3,591,000.00	0.32
6	000895	双汇发展	3,524,499.00	0.31
7	601989	中国重工	3,001,287.00	0.27
8	600000	浦发银行	2,940,948.00	0.26
9	600036	招商银行	2,199,114.00	0.20
10	000002	万科 A	2,026,475.00	0.18
11	600369	西南证券	1,876,876.54	0.17
12	600030	中信证券	1,811,076.00	0.16
13	600150	中国船舶	1,791,723.00	0.16
14	000157	中联重科	1,747,366.00	0.16
15	600252	中恒集团	1,706,612.00	0.15
16	601699	潞安环能	1,657,913.00	0.15
17	002081	金螳螂	1,568,770.87	0.14
18	600016	民生银行	1,426,446.00	0.13
19	600519	贵州茅台	1,413,511.00	0.13
20	601398	工商银行	1,366,940.00	0.12

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	600109	国金证券	29,579,311.59	2.64
2	000732	泰禾集团	8,730,362.00	0.78
3	000919	金陵药业	4,854,800.00	0.43
4	000933	神火股份	4,684,930.35	0.42
5	000686	东北证券	4,165,180.31	0.37

6	601328	交通银行	3,818,780.08	0.34
7	300017	网宿科技	3,681,804.00	0.33
8	600028	中国石化	3,403,124.65	0.30
9	000895	双汇发展	3,199,218.53	0.29
10	600000	浦发银行	3,164,005.98	0.28
11	601318	中国平安	3,087,392.33	0.28
12	600970	中材国际	2,709,490.50	0.24
13	600036	招商银行	2,518,339.97	0.22
14	600150	中国船舶	2,090,382.65	0.19
15	000830	鲁西化工	1,951,155.79	0.17
16	000625	长安汽车	1,696,643.20	0.15
17	601988	中国银行	1,692,779.73	0.15
18	600019	宝钢股份	1,491,005.39	0.13
19	600741	华域汽车	1,423,119.72	0.13
20	600694	大商股份	1,416,100.59	0.13

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	122,227,796.22
卖出股票收入（成交）总额	129,733,399.82

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 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	-	-
3	金融债券	40,026,000.00	3.71
	其中：政策性金融债	40,026,000.00	3.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	9,251,107.89	0.86
8	其他	-	-
9	合计	49,277,107.89	4.56

## 7.6 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

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	130243	13 国开 43	200,000	20,022,000.00	1.85
2	130236	13 国开 36	200,000	20,004,000.00	1.85
3	110015	石化转债	27,000	2,915,190.00	0.27
4	113002	工行转债	25,700	2,708,780.00	0.25
5	113001	中行转债	14,990	1,525,832.10	0.14

## 7.7 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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.9 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持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.11.2 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持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 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	61,199.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,391,710.70
5	应收申购款	100,100,764.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,553,675.28

### 7.12.4 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	110015	石化转债	2,915,190.00	0.27
2	113002	工行转债	2,708,780.00	0.25
3	113001	中行转债	1,525,832.10	0.14
4	110016	川投转债	1,000,757.50	0.09
5	110023	民生转债	928,000.00	0.09
6	127002	徐工转债	86,633.89	0.01
7	113006	深燃转债	85,914.40	0.01

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五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	000721	西安饮食	2,916,000.00	0.27	非公开发行

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
30,861	45,754.82	316,509,653.65	22.42%	1,095,529,803.88	77.58%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	许飞	600,030.00	3.29%
2	周雷	600,030.00	3.29%
3	王厚芳	530,026.00	2.91%
4	林其葳	510,000.00	2.80%
5	刘爽	400,052.00	2.19%
6	王芳	400,020.00	2.19%
7	王乐京	300,042.00	1.65%
8	朱坤琛	272,007.00	1.49%
9	姜海波	200,070.00	1.10%
10	庄惠	200,022.00	1.10%

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的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	1,159,732.92	0.0821%



#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 11 月 2 日) 基金份额总额	2,955,476,122.49
本报告期期初基金份额总额	1,393,516,681.59
本报告期基金总申购份额	228,479,091.20
减:本报告期基金总赎回份额	209,956,315.26
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,412,039,457.53

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 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) 报告期内基金管理人重大人事变动：

2014 年 2 月 26 日，兴业全球基金管理有限公司副总经理王晓明离任。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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

金额单位：人民币元

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
民族证券	1	137,414,606.05	55.67%	97,618.98	55.65%	-
兴业证券	2	109,410,605.39	44.33%	77,800.52	44.35%	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
民族证券	17,019,238.00	88.58%	143,500,000.00	96.50%	-	-
兴业证券	2,194,702.66	11.42%	5,200,000.00	3.50%	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2013 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 1 日
2	关于长期停牌股票（汤臣倍健）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 1 月 28 日
3	关于增加和讯信息科技有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 14 日
4	关于通过和讯信息科技有限公司申购或定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 14 日
5	关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 20 日
6	关于通过上海好买基金销售有限公司申购或定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 20 日
7	关于副总经理离任的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 27 日
8	关于长期停牌股票（新华医疗）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 28 日
9	关于增加杭州数米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 28 日
10	关于通过杭州数米基金销售有限公司申购或定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 2 月 28 日
11	关于部分独立董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 20 日
12	关于在浦发银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2014 年 3 月 24 日

13	关于在安信证券开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 3 月 25 日
14	关于长期停牌股票（互动娱乐）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 3 月 29 日
15	关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 4 月 1 日
16	关于旗下基金持有的“10 杉杉债（122050）”债券估值方法调整的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 4 月 9 日
17	关于长期停牌股票（长信科技）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 4 月 30 日
18	关于长期停牌股票（和佳股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 4 月 30 日
19	关于长期停牌股票（卫宁软件）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 5 月 30 日
20	关于调整部分销售渠道申购及追加申购起点的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 6 月 27 日
21	关于调整官方淘宝店基金申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2014 年 6 月 27 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xyfunds.com.cn>) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴业全球基金管理有限公司

2014 年 8 月 27 日