

# 兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

## 2015 年半年度报告

2015 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 25 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 2015 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             | 4        |
| 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        |
| 3.3 其他指标                    | 7        |
| <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  | 9        |
| 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 | 10       |
| 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     | 11       |

|                                               |           |
|-----------------------------------------------|-----------|
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....       | 11        |
| <b>§5 托管人报告.....</b>                          | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 11        |
| 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 ..... | 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>12</b> |
| 6.1 资产负债表.....                                | 12        |
| 6.2 利润表.....                                  | 13        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 14        |
| 6.4 报表附注.....                                 | 15        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                         | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 34        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....                      | 34        |
| 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 .....       | 35        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 37        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 38        |
| 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 .....      | 39        |
| 7.7 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 .....   | 39        |
| 7.8 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 .....   | 39        |
| 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 .....      | 39        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....               | 39        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....               | 39        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                            | 40        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                      | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                    | 41        |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 .....                        | 41        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                | 41        |
| 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 .....       | 42        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                      | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                        | <b>42</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                        | 42        |
| 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 .....        | 42        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....             | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                           | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                   | 43        |
| 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 .....           | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                  | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                             | 45        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>                | <b>49</b> |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                        | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                              | 49        |
| 12.2 存放地点.....                                | 49        |
| 12.3 查阅方式.....                                | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                      |
|--------------|----------------------|
| 基金名称         | 兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF） |
| 基金简称         | 兴全趋势投资混合（LOF）        |
| 场内简称         | 兴全趋势                 |
| 基金主代码        | 163402               |
| 前端交易代码       | 163402               |
| 后端交易代码       | 163403               |
| 基金运作方式       | 上市契约型开放式（LOF）        |
| 基金合同生效日      | 2005 年 11 月 3 日      |
| 基金管理人        | 兴业全球基金管理有限公司         |
| 基金托管人        | 兴业银行股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额   | 4,705,733,773.57 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         | 2006-01-19           |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                             |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益，增加投资组合收益的确定性和稳定性；分享中国上市公司高速成长带来的资本增值；减少决策的失误率，实现最优化的风险调整后的投资收益。                                                       |
| 投资策略   | 根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置；运用兴业多维趋势分析系统，对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析，并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面，本基金主要运用“兴业固定收益证券组合优化模型”，在固定收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。 |
| 业绩比较基准 | 中标 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险，中高风险，中高回报的基金产品。                                                                                                        |

### 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 | 兴业银行股份有限公司 |

|         |      |                          |                                 |
|---------|------|--------------------------|---------------------------------|
| 信息披露负责人 | 姓名   | 冯晓莲                      | 张志永                             |
|         | 联系电话 | 021-20398888             | 021-62677777                    |
|         | 电子邮箱 | fengxl@xyfunds.com.cn    | zhangzhy@cib.com.cn             |
| 客户服务电话  |      | 4006780099, 021-38824536 | 95561                           |
| 传真      |      | 021-20398858             | 021-62159217                    |
| 注册地址    |      | 上海市黄浦区金陵东路 368 号         | 福州市湖东路 154 号                    |
| 办公地址    |      | 上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼 | 上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址） |
| 邮政编码    |      | 200122                   | 200041                          |
| 法定代表人   |      | 兰荣                       | 高建平                             |

## 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 | 中国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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日 ) |
|---------------|----------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 4,647,440,790.68                       |
| 本期利润          | 3,799,897,297.24                       |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.5260                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 37.37%                                 |
| 本期基金份额净值增长率   | 40.33%                                 |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )                |
| 期末可供分配利润      | 3,961,796,160.78                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.8419                                 |
| 期末基金资产净值      | 7,422,236,731.10                       |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末基金份额净值     | 1.5773                |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2015 年 6 月 30 日） |
| 基金份额累计净值增长率  | 1,068.47%             |

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      | -9.19%    | 2.52%       | -3.49%     | 1.73%         | -5.70%  | 0.79% |
| 过去三个月      | 12.46%    | 2.05%       | 6.93%      | 1.30%         | 5.53%   | 0.75% |
| 过去六个月      | 40.33%    | 1.66%       | 15.02%     | 1.12%         | 25.31%  | 0.54% |
| 过去一年       | 85.50%    | 1.35%       | 47.29%     | 0.91%         | 38.21%  | 0.44% |
| 过去三年       | 109.64%   | 1.10%       | 45.16%     | 0.73%         | 64.48%  | 0.37% |
| 自基金合同生效起至今 | 1,068.47% | 1.26%       | 195.99%    | 0.92%         | 872.48% | 0.34% |

注：本基金业绩比较基准为中信标普 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中信标普 300 指数选择中国 A 股市场中市值规模最大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股，充分反映了 A 股市场的行业代表性，描述了沪深 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。基于本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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：

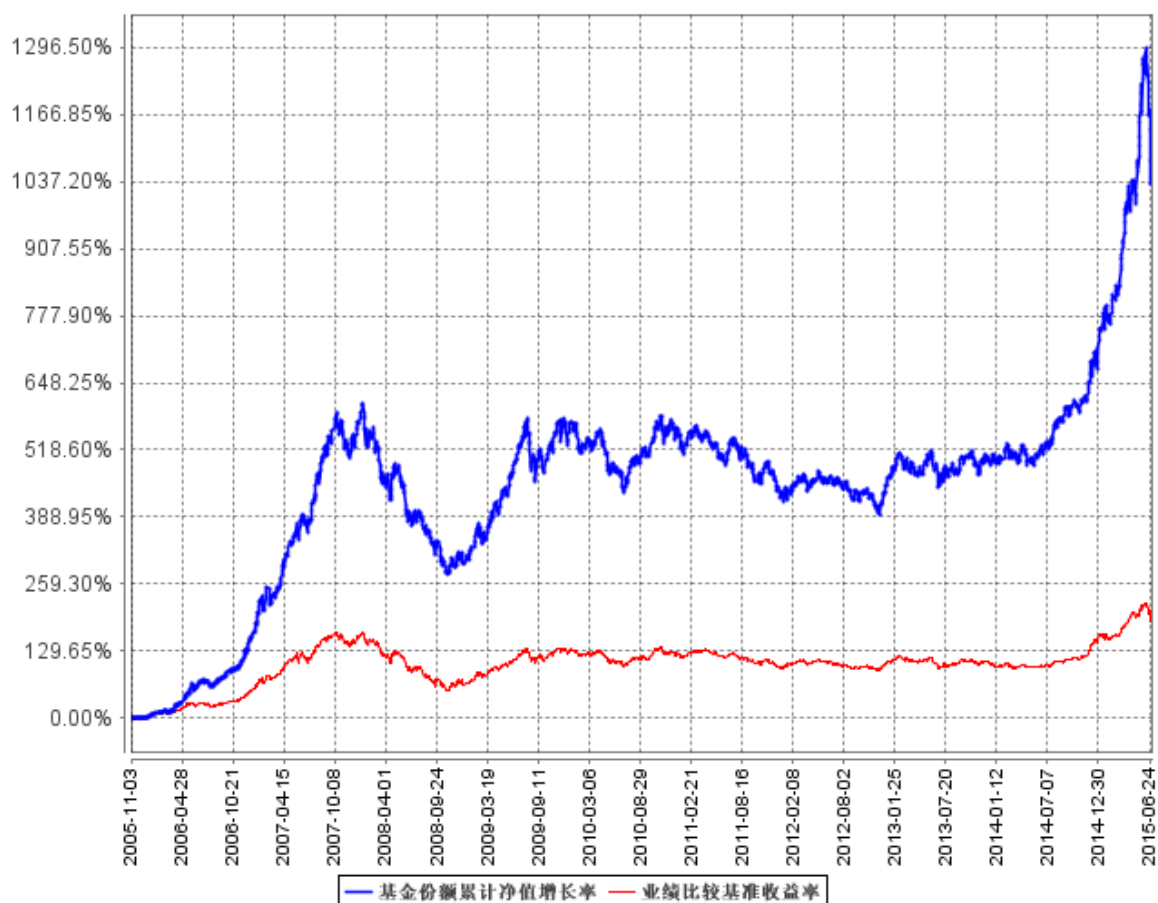
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{中信标普 300 指数}_t / \text{中信标普 300 指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{中信国债指数}_t / \text{中信国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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 2015 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2005 年 11 月 3 日至 2006 年 5 月 2 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。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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 2015 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           |        |                                                                                               |
| 董承非 | 副总经理、基金管理部投资总监，本基金和兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理 | 2013 年 10 月 28 日 | —              | 12 年   | 理学硕士，历任兴业全球基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、基金管理部副总监、兴全商业模式优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理。 |
| 侯梧  | 本基金基金经理                                | 2014 年 11 月 24 日 | —              | 10 年   | 理学硕士，历任平安资产管理有限公司组合管理部任组合经理助理，兴业全球基金管理有限公司任研究员、投资经理。                                          |
| 杨岳斌 | —                                      | 2011 年 12 月 28 日 | 2015 年 1 月 5 日 | —      | —                                                                                             |



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、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（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

回顾上半年，持续宽松的流动性以及对改革的乐观预期，导致 2015 年上半年 A 股大幅上涨。6 月末上证综指收于 4277.22 点，累计上涨 32%，6 月初时最高涨幅接近 60%；创业板指收于 2858.6 点，上半年累计上涨 94.2%，最高涨幅接近 170%。行业方面，计算机、通信和轻工制造是上半年涨幅较高的行业，计算机行业涨幅接近 129%，非银行金融是上半年唯一下跌的行业，金融行业上半年涨幅约 11%，同样排名靠后。行情在二季度呈现出资金推动的特征，4、5 月份指数加速上涨，投资者情绪高涨，6 月份监管层开始对场外配资进行清理，成为了行情转折的催化剂之一，6 月份

单月上证指数下跌 7.3%，创业板指单月下跌 19.3%。杠杆资金对于股市的波动起到了推波助澜的作用。融资融券从 2014 年末的 1 万亿，上升到 5 月份高点的 2.27 万亿。6 月份指数开始下跌，两融余额也回落至 2 万亿。

面对前期过度亢奋和泡沫化的市场，我们上半年的投资策略偏于稳健，尤其是在 4 月底市场突破 4500 点后，我们进一步降低了股票仓位，以应对可能发生的市场风险。市场的回落虽然迟于我们预期，但是市场回调的激烈程度也令很多人惊惧。我们的投资策略虽然前期压力较大，但在市场回调后获得了显著的超额收益。

#### 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 40.33%，同期业绩比较基准收益率 15.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内经济仍将低位运行，稳增长的政策将持续并有可能进一步加码。目前来看稳增长的主要手段依旧是基建投资，而基建投资的大幅增长将阻碍市场利率的进一步下降。股市方面，股票市场在连续的救市措施下，短期强烈反弹。但此轮下跌后，管理层将更加关注对两融等杠杆操作的风险控制，股市自身的资金供给也难以回到前期的高位。因此，我们判断三季度股票市场以震荡为主，配置上更加关注公司业绩和增长的确定性。

#### 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 年以上相关工作经历，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》、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内实施利润分配 1 次，共分配利润 825,497,436.03 元，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 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

本托管人依据《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》与《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》，自 2005 年 11 月 3 日起托管兴业趋势投资（即更名后的“兴全趋势投资”）混合型证券投资基金（LOF）（以下称本基金）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 2,350,829,428.32               | 611,249,848.45                   |
| 结算备付金           |            | 27,122,030.55                  | 14,859,956.97                    |
| 存出保证金           |            | 10,715,775.55                  | 3,152,181.22                     |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 4,197,900,792.69               | 9,311,752,511.35                 |
| 其中：股票投资         |            | 3,945,639,672.99               | 8,053,441,288.75                 |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 252,261,119.70                 | 1,258,311,222.60                 |
| 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    | 937,470,628.73                 | 894,435,421.66                   |
| 应收证券清算款         |            | 139,297,947.32                 | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 8,497,282.05                   | 8,003,561.60                     |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 6,944,370.40                   | 3,267,923.11                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 7,678,778,255.61               | 10,846,721,404.36                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2015 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 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       |            | -                              | 290,000,000.00                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 211,669,881.57                   |
| 应付赎回款           |            | 228,159,425.02                 | 57,703,822.64                    |
| 应付管理人报酬         |            | 11,401,870.92                  | 12,935,486.66                    |
| 应付托管费           |            | 1,900,311.81                   | 2,155,914.45                     |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 14,417,410.07                  | 8,466,172.59                     |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |
| 应付利息            |            | -                              | -                                |

|               |          |                  |                   |
|---------------|----------|------------------|-------------------|
| 应付利润          |          | -                | -                 |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                 |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 662,506.69       | 256,679.37        |
| 负债合计          |          | 256,541,524.51   | 583,187,957.28    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                   |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,178,227,324.84 | 2,099,175,017.90  |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 6,244,009,406.26 | 8,164,358,429.18  |
| 所有者权益合计       |          | 7,422,236,731.10 | 10,263,533,447.08 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 7,678,778,255.61 | 10,846,721,404.36 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5773 元，基金份额总额 4,705,733,773.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至<br>2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           |            | 3,935,492,265.88                         | 408,980,969.30                                |
| 1.利息收入                |            | 23,715,495.49                            | 25,569,778.27                                 |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 14,732,823.85                            | 3,586,419.46                                  |
| 债券利息收入                |            | 8,063,558.90                             | 21,727,001.42                                 |
| 资产支持证券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |            | 919,112.74                               | 256,357.39                                    |
| 其他利息收入                |            | -                                        | -                                             |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 4,755,612,481.94                         | 637,448,774.29                                |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 4,371,416,590.71                         | 530,528,803.26                                |
| 基金投资收益                |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 364,392,920.16                           | 26,067,099.08                                 |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.1 | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -                                        | -                                             |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 19,802,971.07                            | 80,852,871.95                                 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -847,543,493.44                          | -254,292,415.77                               |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                        | -                                             |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 3,707,781.89                             | 254,832.51                                    |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 135,594,968.64                           | 120,918,129.07                                |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 75,605,106.26                            | 67,115,199.73                                 |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 12,600,851.06                            | 11,185,866.57                                 |
| 3. 销售服务费              | 6.4.10.2.3 | -                                        | -                                             |

|                     |          |                  |                |
|---------------------|----------|------------------|----------------|
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19 | 45,784,429.44    | 9,779,478.09   |
| 5. 利息支出             |          | 1,382,283.34     | 32,545,165.46  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 1,382,283.34     | 32,545,165.46  |
| 6. 其他费用             | 6.4.7.20 | 222,298.54       | 292,419.22     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 3,799,897,297.24 | 288,062,840.23 |
| 减：所得税费用             |          | -                | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 3,799,897,297.24 | 288,062,840.23 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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）                        | 2,099,175,017.90                           | 8,164,358,429.18  | 10,263,533,447.08 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | 3,799,897,297.24  | 3,799,897,297.24  |
| 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）      | -920,947,693.06                            | -4,894,748,884.13 | -5,815,696,577.19 |
| 其中：1.基金申购款                             | 349,942,606.63                             | 1,482,200,740.48  | 1,832,143,347.11  |
| 2.基金赎回款                                | -1,270,890,299.69                          | -6,376,949,624.61 | -7,647,839,924.30 |
| 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） | -                                          | -825,497,436.03   | -825,497,436.03   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,178,227,324.84                           | 6,244,009,406.26  | 7,422,236,731.10  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 2,535,280,220.07 | 6,845,761,224.65 | 9,381,041,444.72  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                | 288,062,840.23   | 288,062,840.23    |
| 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）      | -87,144,873.46   | -233,276,173.95  | -320,421,047.41   |
| 其中：1.基金申购款                             | 212,212,170.28   | 579,087,348.34   | 791,299,518.62    |
| 2.基金赎回款                                | -299,357,043.74  | -812,363,522.29  | -1,111,720,566.03 |
| 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）                        | 2,448,135,346.61 | 6,900,547,890.93 | 9,348,683,237.54  |

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：

\_\_\_\_\_  
兰荣  
基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
杨东  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
詹鸿飞  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）（原名兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF））（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”）证监基金字（2005）156 号文《关于同意兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）募集的批复》的核准，由兴业全球基金管理有限公司（原名“兴业基金管理有限公司”）作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2005 年 11 月 3 日正式生效，首次设立募集规模为 927,645,098.72 份基金份额。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为兴业全球基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）于 2011 年 1 月 1 日更名为兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）。

本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行、上市交易的股票和固定收益证券（包括各种债券和货币市场工具）以及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

本基金的业绩比较基准为：中标 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%。

2007 年 5 月 11 日，本基金管理人兴业全球基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.2504 元。

#### 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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不一致。详见 6.4.5。

#### 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

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的要求，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

##### 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

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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。

### 6.4.6.3 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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,350,829,428.32       |
| 定期存款           | —                      |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | —                      |
| 其他存款           | —                      |
| 合计：            | 2,350,829,428.32       |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |                  |                |
|---------------|-------|------------------------|------------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 2,979,317,115.67       | 3,945,639,672.99 | 966,322,557.32 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | —                      | —                | —              |
| 债券            | 交易所市场 | 249,567,000.00         | 252,261,119.70   | 2,694,119.70   |
|               | 银行间市场 | —                      | —                | —              |
|               | 合计    | 249,567,000.00         | 252,261,119.70   | 2,694,119.70   |
| 资产支持证券        |       | —                      | —                | —              |
| 基金            |       | —                      | —                | —              |
| 其他            |       | —                      | —                | —              |
| 合计            |       | 3,228,884,115.67       | 4,197,900,792.69 | 969,016,677.02 |

##### 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**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |           |
|------------|------------------------|-----------|
|            | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券_银行间 | 937,470,628.73         | —         |
| 合计         | 937,470,628.73         | —         |

**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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,201,997.35           |
| 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  | 10,984.41              |
| 应收债券利息     | 7,208,167.14           |
| 应收买入返售证券利息 | 33,197.08              |
| 应收申购款利息    | 38,596.18              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —                      |
| 其他         | 4,339.89               |
| 合计         | 8,497,282.05           |

**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<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 14,412,137.79          |
| 银行间市场应付交易费用 | 5,272.28               |
| 合计          | 14,417,410.07          |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                      |
| 应付赎回费       | 372,235.42             |
| 预提费用        | 208,273.08             |
| 其他          | 81,998.19              |
| 合计          | 662,506.69             |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 8,383,887,073.21                      | 2,099,175,017.90  |
| 本期申购          | 1,397,652,173.78                      | 349,942,606.63    |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -5,075,805,473.42                     | -1,270,890,299.69 |
| — 基金拆分/份额折算前  | —                                     | —                 |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | —                                     | —                 |
| 本期申购          | —                                     | —                 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | —                                     | —                 |
| 本期末           | 4,705,733,773.57                      | 1,178,227,324.84  |

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           | 2,005,823,589.41  | 6,158,534,839.77  | 8,164,358,429.18  |
| 本期利润           | 4,647,440,790.68  | -847,543,493.44   | 3,799,897,297.24  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,865,970,783.28 | -3,028,778,100.85 | -4,894,748,884.13 |
| 其中：基金申购款       | 424,656,924.11    | 1,057,543,816.37  | 1,482,200,740.48  |
| 基金赎回款          | -2,290,627,707.39 | -4,086,321,917.22 | -6,376,949,624.61 |
| 本期已分配利润        | -825,497,436.03   | —                 | -825,497,436.03   |
| 本期末            | 3,961,796,160.78  | 2,282,213,245.48  | 6,244,009,406.26  |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 14,490,706.59                         |
| 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 | 172,092.08                            |
| 其他        | 70,025.18                             |
| 合计        | 14,732,823.85                         |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 19,579,051,386.73                     |
| 减：卖出股票成本总额 | 15,207,634,796.02                     |
| 买卖股票差价收入   | 4,371,416,590.71                      |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 364,392,920.16             |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                          |
| 合计                            | 364,392,920.16             |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,390,920,915.45           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,015,158,270.88           |

|          |                |
|----------|----------------|
| 减：应收利息总额 | 11,369,724.41  |
| 买卖债券差价收入 | 364,392,920.16 |

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 19,802,971.07                         |
| 基金投资产生的股利收益 | -                                     |
| 合计          | 19,802,971.07                         |

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -847,543,493.44                       |
| ——股票投资     | -467,048,888.76                       |
| ——债券投资     | -380,494,604.68                       |
| ——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         | -847,543,493.44                       |

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 3,131,723.86                          |

|       |              |
|-------|--------------|
| 其他收入  | 50.00        |
| 转换费收入 | 576,008.03   |
| 合计    | 3,707,781.89 |

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 45,783,779.44                         |
| 银行间市场交易费用 | 650.00                                |
| 合计        | 45,784,429.44                         |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用   | 59,507.37                             |
| 信息披露费  | 148,765.71                            |
| 账户维护费用 | 9,000.00                              |
| 银行手续费  | 4,825.46                              |
| 其他费用   | 200.00                                |
| 合计     | 222,298.54                            |

#### 6.4.7.21 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    |
| 兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）     | 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<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比<br>例 |
| 兴业证券  | 11,059,954,899.93          | 37.00%               | 1,141,961,179.28                | 17.61%               |

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                      | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                      |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期债券<br>成交总额的比<br>例 |
| 兴业证券  | 18,549,233.33              | 9.57%                | 528,740,850.32                  | 21.17%               |

##### 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<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                            | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                            |
|-------|----------------------------|----------------------------|---------------------------------|----------------------------|
|       | 回购成交金额                     | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的<br>比例 | 回购成交金额                          | 占当期债券<br>回购<br>成交总额的比<br>例 |
| 兴业证券  | 450,000,000.00             | 41.10%                     | 2,500,000,000.00                | 17.06%                     |



**6.4.10.1.4 权证交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间内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<br>2015年1月1日至2015年6月30日      |                |              |                  |
|-------|---------------------------------|----------------|--------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 兴业证券  | 7,949,978.57                    | 34.72%         | 5,364,122.21 | 37.22%           |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |                |              |                  |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金<br>总量的比例 | 期末应付佣金余额     | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 兴业证券  | 812,769.38                      | 15.30%         | 375,109.93   | 24.40%           |

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<br>2015年1月1日至2015年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 75,605,106.26                  | 67,115,199.73                   |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 14,078,719.03                  | 14,232,608.17                   |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%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×1.5%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年6月30日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 12,600,851.06              | 11,185,866.57                   |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%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×0.25%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |               | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 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       |
| 兴业银行  | 2,350,829,428.32                      | 14,490,706.59 | 399,763,607.36                             | 3,400,217.02 |

### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于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

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日       | 除息日             |                 | 每 10 份<br>基金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形式<br>发放总额  | 本期利润分配<br>合计   | 备注 |
|----|-----------------|-----------------|-----------------|-----------------------|----------------|----------------|----------------|----|
|    |                 | 场内              | 场外              |                       |                |                |                |    |
| 1  | 2015 年 1 月 13 日 | 2015 年 1 月 14 日 | 2015 年 1 月 13 日 | 1.030                 | 363,269,864.50 | 462,227,571.53 | 825,497,436.03 |    |
| 合计 | -               | -               | -               | 1.030                 | 363,269,864.50 | 462,227,571.53 | 825,497,436.03 |    |

### 6.4.12 期末（2015 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<br>(单位：股) | 期末成本总额         | 期末估值总额         | 备注 |
|--------|--------|------------------|------------------|------------|-------|--------|--------------|----------------|----------------|----|
| 600401 | *ST 海润 | 2014 年 9 月 16 日  | 2015 年 9 月 14 日  | 非公开发行流通受限  | 7.72  | 3.82   | 17,990,000   | 138,882,800.00 | 68,721,800.00  | -  |
| 600401 | *ST 海润 | 2015 年 5 月 28 日  | 2015 年 9 月 14 日  | 非公开发行 - 转增 | -     | 3.82   | 35,980,000   | -              | 137,443,600.00 | 1  |
| 000050 | 深天马 A  | 2014 年 9 月 26 日  | 2015 年 9 月 29 日  | 非公开发行流通受限  | 14.60 | 21.17  | 7,188,767    | 104,955,998.20 | 152,186,197.39 | -  |
| 000863 | 三湘股份   | 2014 年 11 月 28 日 | 2015 年 12 月 1 日  | 非公开发行流通受限  | 5.41  | 8.72   | 15,100,000   | 81,691,000.00  | 131,672,000.00 | -  |
| 600584 | 长电科技   | 2014 年 9 月 30 日  | 2015 年 9 月 26 日  | 非公开发行流通受限  | 9.51  | 16.63  | 6,310,000    | 60,008,100.00  | 104,935,300.00 | -  |
| 601636 | 旗滨集团   | 2015 年 4 月 3 日   | 2016 年 4 月 1 日   | 非公开发行流通受限  | 7.20  | 8.06   | 13,010,000   | 93,672,000.00  | 104,860,600.00 | -  |
| 600773 | 西藏城投   | 2014 年 11 月 18 日 | 2015 年 11 月 17 日 | 非公开发行流通受限  | 9.74  | 14.59  | 3,670,000    | 35,745,800.00  | 53,545,300.00  | -  |
| 300336 | 新文化    | 2015 年 2 月 10 日  | 2016 年 2 月 12 日  | 非公开发行流通受限  | 26.75 | 16.56  | 1,200,000    | 32,100,000.00  | 19,872,000.00  | -  |
| 300336 | 新文化    | 2015 年 5 月 26 日  | 2016 年 2 月 12 日  | 非公开发行 - 转增 | -     | 16.56  | 1,440,000    | -              | 23,846,400.00  | 2  |
| 002585 | 双星新材   | 2014 年 8 月 11 日  | 2015 年 8 月 12 日  | 非公开发行流通受限  | 10.31 | 15.72  | 1,939,049    | 19,991,595.19  | 30,481,850.28  | -  |
| 002585 | 双星新材   | 2015 年 6 月 9 日   | 2015 年 8 月 12 日  | 非公开发行 - 转增 | -     | 15.72  | 581,715      | -              | 9,144,559.80   | 3  |
| 300406 | 九强生物   | 2014 年 10 月 27 日 | 2015 年 10 月 30 日 | 新股流通受限     | 14.32 | 46.82  | 216,341      | 3,098,003.12   | 10,129,085.62  | -  |
| 300406 | 九强生物   | 2015 年 4 月 20 日  | 2015 年 10 月 30 日 | 新股 - 转增    | -     | 46.82  | 216,341      | -              | 10,129,085.62  | 4  |

|        |          |                       |                       |                   |       |       |        |              |              |   |
|--------|----------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-------|-------|--------|--------------|--------------|---|
|        |          | 日                     | 月 30<br>日             |                   |       |       |        |              |              |   |
| 300004 | 南风<br>股份 | 2014 年<br>6 月 24<br>日 | 2015<br>年 7 月<br>14 日 | 非公开<br>发行流<br>通受限 | 28.43 | 66.62 | 40,000 | 1,137,200.00 | 2,664,800.00 | - |

注：

- 1、 本基金持有的非公开发行股票\*ST 海润，于 2015 年 5 月 28 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 20 股，本基金新增 35,980,000 股。
- 2、 本基金持有的非公开发行股票新文化，于 2015 年 5 月 26 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 12 股，本基金新增 1,440,000 股。
- 3、 本基金持有的非公开发行股票双星新材，于 2015 年 6 月 9 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，本基金新增 581,715 股。
- 4、 本基金持有的非公开发行股票九强生物，于 2015 年 4 月 20 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股，本基金新增 216,341 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

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |            |                        |                       |                   |          |            |              |                |                |    |
|----------------------|------------|------------------------|-----------------------|-------------------|----------|------------|--------------|----------------|----------------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称   | 成功<br>认购日              | 可流<br>通日              | 流通<br>受限<br>类型    | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末<br>成本总额     | 期末估值总额         | 备注 |
| 600401               | *ST 海<br>润 | 2014 年<br>9 月 16<br>日  | 2015<br>年 9 月<br>14 日 | 非公开<br>发行流<br>通受限 | 7.72     | 3.82       | 17,990,000   | 138,882,800.00 | 68,721,800.00  | -  |
| 600401               | *ST 海<br>润 | 2015 年<br>5 月 28<br>日  | 2015<br>年 9 月<br>14 日 | 非公开<br>发行 -<br>转增 | -        | 3.82       | 35,980,000   | -              | 137,443,600.00 | 1  |
| 000050               | 深天<br>马 A  | 2014 年<br>9 月 26<br>日  | 2015<br>年 9 月<br>29 日 | 非公开<br>发行流<br>通受限 | 14.60    | 21.17      | 7,188,767    | 104,955,998.20 | 152,186,197.39 | -  |
| 000863               | 三湘<br>股份   | 2014 年<br>11 月 28<br>日 | 2015<br>年 12<br>月 1 日 | 非公开<br>发行流<br>通受限 | 5.41     | 8.72       | 15,100,000   | 81,691,000.00  | 131,672,000.00 | -  |
| 600584               | 长电<br>科技   | 2014 年<br>9 月 30<br>日  | 2015<br>年 9 月<br>26 日 | 非公开<br>发行流<br>通受限 | 9.51     | 16.63      | 6,310,000    | 60,008,100.00  | 104,935,300.00 | -  |
| 601636               | 旗滨<br>集团   | 2015 年<br>4 月 3 日      | 2016<br>年 4 月<br>1 日  | 非公开<br>发行流<br>通受限 | 7.20     | 8.06       | 13,010,000   | 93,672,000.00  | 104,860,600.00 | -  |

|        |      |                  |                  |            |       |        |           |               |               |   |
|--------|------|------------------|------------------|------------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|---|
| 600773 | 西藏城投 | 2014 年 11 月 18 日 | 2015 年 11 月 17 日 | 非公开发行流通受限  | 9.74  | 14.59  | 3,670,000 | 35,745,800.00 | 53,545,300.00 | - |
| 300336 | 新文化  | 2015 年 2 月 10 日  | 2016 年 2 月 12 日  | 非公开发行流通受限  | 26.75 | 16.56  | 1,200,000 | 32,100,000.00 | 19,872,000.00 | - |
| 300336 | 新文化  | 2015 年 5 月 26 日  | 2016 年 2 月 12 日  | 非公开发行 - 转增 | -     | 16.56  | 1,440,000 | -             | 23,846,400.00 | 2 |
| 002585 | 双星新材 | 2014 年 8 月 11 日  | 2015 年 8 月 12 日  | 非公开发行流通受限  | 10.31 | 15.72  | 1,939,049 | 19,991,595.19 | 30,481,850.28 | - |
| 002585 | 双星新材 | 2015 年 6 月 9 日   | 2015 年 8 月 12 日  | 非公开发行 - 转增 | -     | 15.72  | 581,715   | -             | 9,144,559.80  | 3 |
| 300406 | 九强生物 | 2014 年 10 月 27 日 | 2015 年 10 月 30 日 | 新股流通受限     | 14.32 | 46.82  | 216,341   | 3,098,003.12  | 10,129,085.62 | - |
| 300406 | 九强生物 | 2015 年 4 月 20 日  | 2015 年 10 月 30 日 | 新股 - 转增    | -     | 46.82  | 216,341   | -             | 10,129,085.62 | 4 |
| 300004 | 南风股份 | 2014 年 6 月 24 日  | 2015 年 7 月 14 日  | 非公开发行流通受限  | 28.43 | 66.62  | 40,000    | 1,137,200.00  | 2,664,800.00  | - |
| 300436 | 广生堂  | 2015 年 4 月 16 日  | 2016 年 4 月 15 日  | 新股流通受限     | 21.47 | 149.39 | 47,297    | 1,015,466.59  | 7,065,698.83  | - |

注：

- 1、 本基金持有的非公开发行股票\*ST 海润，于 2015 年 5 月 28 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 20 股，本基金新增 35,980,000 股。
- 2、 本基金持有的非公开发行股票新文化，于 2015 年 5 月 26 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 12 股，本基金新增 1,440,000 股。
- 3、 本基金持有的非公开发行股票双星新材，于 2015 年 6 月 9 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股，本基金新增 581,715 股。
- 4、 本基金持有的非公开发行股票九强生物，于 2015 年 4 月 20 日实施 2014 年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股，本基金新增 216,341 股。

可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

### **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**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告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。本基金投资于一家公司发行的证券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<br>2015 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                   | 2,350,829,428.32 | -      | -              | -             | -     | -                | 2,350,829,428.32 |
| 结算备付金                  | 27,122,030.55    | -      | -              | -             | -     | -                | 27,122,030.55    |
| 存出保证金                  | 10,715,775.55    | -      | -              | -             | -     | -                | 10,715,775.55    |
| 交易性金融资产                | -                | 0.00   | 200,980,000.00 | 51,281,119.70 | -     | 3,945,639,672.99 | 4,197,900,792.69 |
| 买入返售金融资产               | 937,470,628.73   | -      | -              | -             | -     | -                | 937,470,628.73   |
| 应收证券清算款                | -                | -      | -              | -             | -     | 139,297,947.32   | 139,297,947.32   |
| 应收利息                   | -                | -      | -              | -             | -     | 8,497,282.05     | 8,497,282.05     |
| 应收申购款                  | 138,292.63       | -      | -              | -             | -     | 6,806,077.77     | 6,944,370.40     |
| 其他资产                   | -                | -      | -              | -             | -     | -                | -                |
| 资产总计                   | 3,326,276,155.78 | 0.00   | 200,980,000.00 | 51,281,119.70 | -     | 4,100,240,980.13 | 7,678,778,255.61 |
| 负债                     |                  |        |                |               |       |                  |                  |
| 应付赎回款                  | -                | -      | -              | -             | -     | 228,159,425.02   | 228,159,425.02   |
| 应付管理人报酬                | -                | -      | -              | -             | -     | 11,401,870.92    | 11,401,870.92    |
| 应付托管费                  | -                | -      | -              | -             | -     | 1,900,311.81     | 1,900,311.81     |
| 应付交易费用                 | -                | -      | -              | -             | -     | 14,417,410.07    | 14,417,410.07    |
| 其他负债                   | -                | -      | -              | -             | -     | 662,506.69       | 662,506.69       |
| 负债总计                   | -                | -      | -              | -             | -     | 256,541,524.51   | 256,541,524.51   |
| 利率敏感度缺口                | 3,326,276,155.78 | 0.00   | 200,980,000.00 | 51,281,119.70 | -     | 3,843,699,455.62 | 7,422,236,731.10 |
| 上年度末                   | 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               |

| 2014 年 12 月 31 日 |                  | 月    |                |               | 以上 |                  |                   |
|------------------|------------------|------|----------------|---------------|----|------------------|-------------------|
| 资产               |                  |      |                |               |    |                  |                   |
| 银行存款             | 611,249,848.45   | -    | -              | -             | -  | -                | 611,249,848.45    |
| 结算备付金            | 14,859,956.97    | -    | -              | -             | -  | -                | 14,859,956.97     |
| 存出保证金            | 3,152,181.22     | -    | -              | -             | -  | -                | 3,152,181.22      |
| 交易性金融资产          | 909,728,157.60   | 0.00 | 299,910,000.00 | 48,673,065.00 | -  | 8,053,441,288.75 | 9,311,752,511.35  |
| 买入返售金融资产         | 894,435,421.66   | -    | -              | -             | -  | -                | 894,435,421.66    |
| 应收利息             | -                | -    | -              | -             | -  | 8,003,561.60     | 8,003,561.60      |
| 应收申购款            | 66,830.91        | -    | -              | -             | -  | 3,201,092.20     | 3,267,923.11      |
| 其他资产             | -                | -    | -              | -             | -  | 0.00             | 0.00              |
| 资产总计             | 2,433,492,396.81 | -    | 299,910,000.00 | 48,673,065.00 | -  | 8,064,645,942.55 | 10,846,721,404.36 |
| 负债               |                  |      |                |               |    |                  |                   |
| 卖出回购金融资产款        | 290,000,000.00   | -    | -              | -             | -  | -                | 290,000,000.00    |
| 应付证券清算款          | -                | -    | -              | -             | -  | 211,669,881.57   | 211,669,881.57    |
| 应付赎回款            | -                | -    | -              | -             | -  | 57,703,822.64    | 57,703,822.64     |
| 应付管理人报酬          | -                | -    | -              | -             | -  | 12,935,486.66    | 12,935,486.66     |
| 应付托管费            | -                | -    | -              | -             | -  | 2,155,914.45     | 2,155,914.45      |
| 应付交易费用           | -                | -    | -              | -             | -  | 8,466,172.59     | 8,466,172.59      |
| 其他负债             | -                | -    | -              | -             | -  | 256,679.37       | 256,679.37        |
| 负债总计             | 290,000,000.00   | -    | -              | -             | -  | 293,187,957.28   | 583,187,957.28    |
| 利率敏感度缺口          | 2,143,492,396.81 | -    | 299,910,000.00 | 48,673,065.00 | -  | 7,771,457,985.27 | 10,263,533,447.08 |

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（2015 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2014 年 12 月 31 日） |
|    | 利率 +1%                         | -1,868,104.48               | -2,743,418.48          |
|    | 利率 -1%                         | 1,919,752.15                | 2,815,439.43           |

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基金资产净值的 30%-95%；固定收益类证券为 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券比例在 5%以上。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<br>2015 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>2014 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  | 3,945,639,672.99       | 53.16         | 8,053,441,288.75         | 78.47         |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                      | —             | —                        | —             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 252,261,119.70         | 3.40          | 1,258,311,222.60         | 12.26         |
| 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            | 4,197,900,792.69       | 56.56         | 9,311,752,511.35         | 90.73         |

##### 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（2015 年 6 月 30 日） | 上年度末（2014 年 12 月 31 日） |
|  | 业绩比较基准 +10% | 692,160,519.26       | 966,758,460.98         |
|  | 业绩比较基准 -10% | -692,160,519.26      | -966,758,460.98        |

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              | 3,945,639,672.99 | 51.38         |
|    | 其中：股票             | 3,945,639,672.99 | 51.38         |
| 2  | 固定收益投资            | 252,261,119.70   | 3.29          |
|    | 其中：债券             | 252,261,119.70   | 3.29          |
|    | 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          | 937,470,628.73   | 12.21         |
|    | 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      | 2,377,951,458.87 | 30.97         |
| 7  | 其他各项资产            | 165,455,375.32   | 2.15          |
| 8  | 合计                | 7,678,778,255.61 | 100.00        |

### 7.2 期末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 | 采矿业              | -                | -     |
| C | 制造业              | 2,808,348,039.88 | 37.84 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -     |
| E | 建筑业              | 146,714,553.12   | 1.98  |
| F | 批发和零售业           | 267,600,000.00   | 3.61  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -     |
| H | 住宿和餐饮业           | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 299,654,719.39   | 4.04  |
| J | 金融业              | -                | -     |
| K | 房地产业             | 192,255,733.60   | 2.59  |
| 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        | 231,066,627.00   | 3.11  |
| S | 综合               | -                | -     |
|   | 合计               | 3,945,639,672.99 | 53.16 |

### 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

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  | 002594 | 比亚迪    | 8,518,282  | 470,464,714.86 | 6.34         |
| 2  | 600398 | 海澜之家   | 14,571,120 | 264,174,405.60 | 3.56         |
| 3  | 600401 | *ST 海润 | 54,475,892 | 208,274,969.64 | 2.81         |
| 4  | 300336 | 新文化    | 9,296,650  | 202,412,936.00 | 2.73         |
| 5  | 300255 | 常山药业   | 6,448,553  | 177,851,091.74 | 2.40         |
| 6  | 601933 | 永辉超市   | 15,000,000 | 173,850,000.00 | 2.34         |
| 7  | 601100 | 恒立油缸   | 9,200,825  | 167,731,039.75 | 2.26         |
| 8  | 000050 | 深天马 A  | 7,188,767  | 152,186,197.39 | 2.05         |
| 9  | 601886 | 江河创建   | 9,859,849  | 146,714,553.12 | 1.98         |
| 10 | 300290 | 荣科科技   | 3,580,981  | 143,167,620.38 | 1.93         |

|    |        |        |            |                |      |
|----|--------|--------|------------|----------------|------|
| 11 | 300145 | 南方泵业   | 3,002,480  | 131,958,996.00 | 1.78 |
| 12 | 000863 | 三湘股份   | 15,100,000 | 131,672,000.00 | 1.77 |
| 13 | 002466 | 天齐锂业   | 1,896,633  | 117,211,919.40 | 1.58 |
| 14 | 300039 | 上海凯宝   | 7,475,960  | 116,251,178.00 | 1.57 |
| 15 | 300054 | 鼎龙股份   | 4,131,859  | 109,535,582.09 | 1.48 |
| 16 | 600584 | 长电科技   | 6,310,000  | 104,935,300.00 | 1.41 |
| 17 | 601636 | 旗滨集团   | 13,010,000 | 104,860,600.00 | 1.41 |
| 18 | 000963 | 华东医药   | 1,500,000  | 93,750,000.00  | 1.26 |
| 19 | 002527 | 新时达    | 3,829,002  | 92,853,298.50  | 1.25 |
| 20 | 600079 | 人福医药   | 2,499,943  | 92,622,888.15  | 1.25 |
| 21 | 300271 | 华宇软件   | 1,983,648  | 86,903,618.88  | 1.17 |
| 22 | 002651 | 利君股份   | 1,495,800  | 64,618,560.00  | 0.87 |
| 23 | 002329 | 皇氏集团   | 1,061,646  | 61,310,056.50  | 0.83 |
| 24 | 600366 | 宁波韵升   | 1,566,380  | 54,964,274.20  | 0.74 |
| 25 | 600773 | 西藏城投   | 3,670,000  | 53,545,300.00  | 0.72 |
| 26 | 600587 | 新华医疗   | 994,358    | 49,876,997.28  | 0.67 |
| 27 | 300075 | 数字政通   | 1,299,992  | 48,996,698.48  | 0.66 |
| 28 | 300261 | 雅本化学   | 1,843,943  | 43,701,449.10  | 0.59 |
| 29 | 002118 | 紫鑫药业   | 2,479,897  | 42,902,218.10  | 0.58 |
| 30 | 002585 | 双星新材   | 2,520,764  | 39,626,410.08  | 0.53 |
| 31 | 300273 | 和佳股份   | 1,306,100  | 38,908,719.00  | 0.52 |
| 32 | 002335 | 科华恒盛   | 850,090    | 30,756,256.20  | 0.41 |
| 33 | 601801 | 皖新传媒   | 982,300    | 28,653,691.00  | 0.39 |
| 34 | 300195 | 长荣股份   | 640,000    | 20,454,400.00  | 0.28 |
| 35 | 300406 | 九强生物   | 432,682    | 20,258,171.24  | 0.27 |
| 36 | 300377 | 赢时胜    | 98,035     | 18,408,031.95  | 0.25 |
| 37 | 300100 | 双林股份   | 770,141    | 14,655,783.23  | 0.20 |
| 38 | 300436 | 广生堂    | 47,297     | 7,065,698.83   | 0.10 |
| 39 | 600732 | *ST 新梅 | 799,822    | 7,038,433.60   | 0.09 |
| 40 | 002539 | 新都化工   | 172,401    | 5,671,992.90   | 0.08 |
| 41 | 300004 | 南风股份   | 40,000     | 2,664,800.00   | 0.04 |
| 42 | 300467 | 迅游科技   | 3,726      | 1,107,739.80   | 0.01 |
| 43 | 300468 | 四方精创   | 12,309     | 1,059,804.90   | 0.01 |
| 44 | 600570 | 恒生电子   | 100        | 11,205.00      | 0.00 |
| 45 | 002177 | 御银股份   | 5          | 72.10          | 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  | 601939 | 建设银行 | 1,013,399,544.00 | 9.87           |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 950,805,532.60   | 9.26           |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 844,365,000.00   | 8.23           |
| 4  | 601231 | 环旭电子 | 830,025,000.00   | 8.09           |
| 5  | 002594 | 比亚迪  | 602,677,503.99   | 5.87           |
| 6  | 000831 | 五矿稀土 | 554,337,000.00   | 5.40           |
| 7  | 600406 | 国电南瑞 | 462,775,232.42   | 4.51           |
| 8  | 600079 | 人福医药 | 319,705,386.83   | 3.11           |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 278,140,824.01   | 2.71           |
| 10 | 600398 | 海澜之家 | 264,657,162.00   | 2.58           |
| 11 | 300017 | 网宿科技 | 264,284,938.08   | 2.57           |
| 12 | 601988 | 中国银行 | 228,786,300.86   | 2.23           |
| 13 | 600019 | 宝钢股份 | 226,112,962.01   | 2.20           |
| 14 | 002081 | 金螳螂  | 224,276,858.42   | 2.19           |
| 15 | 002174 | 游族网络 | 164,241,000.00   | 1.60           |
| 16 | 300039 | 上海凯宝 | 154,563,479.71   | 1.51           |
| 17 | 600060 | 海信电器 | 153,956,402.36   | 1.50           |
| 18 | 000963 | 华东医药 | 137,951,335.94   | 1.34           |
| 19 | 601886 | 江河创建 | 135,554,460.90   | 1.32           |
| 20 | 300261 | 雅本化学 | 132,690,000.00   | 1.29           |

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  | 601318 | 中国平安 | 1,830,923,085.85 | 17.84          |
| 2  | 601939 | 建设银行 | 973,968,549.06   | 9.49           |
| 3  | 601231 | 环旭电子 | 862,711,384.86   | 8.41           |
| 4  | 300017 | 网宿科技 | 829,541,212.63   | 8.08           |
| 5  | 601398 | 工商银行 | 820,987,514.24   | 8.00           |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 6  | 601988 | 中国银行 | 697,794,045.78 | 6.80 |
| 7  | 601933 | 永辉超市 | 662,098,223.26 | 6.45 |
| 8  | 000831 | 五矿稀土 | 568,069,039.64 | 5.53 |
| 9  | 600406 | 国电南瑞 | 545,226,647.94 | 5.31 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 511,641,721.62 | 4.99 |
| 11 | 600398 | 海澜之家 | 473,232,846.27 | 4.61 |
| 12 | 600079 | 人福医药 | 466,105,043.68 | 4.54 |
| 13 | 600048 | 保利地产 | 433,633,721.07 | 4.22 |
| 14 | 002466 | 天齐锂业 | 414,857,589.13 | 4.04 |
| 15 | 300003 | 乐普医疗 | 404,161,267.86 | 3.94 |
| 16 | 600600 | 青岛啤酒 | 395,493,216.82 | 3.85 |
| 17 | 002594 | 比亚迪  | 395,420,652.42 | 3.85 |
| 18 | 601601 | 中国太保 | 383,085,222.19 | 3.73 |
| 19 | 000963 | 华东医药 | 328,529,817.01 | 3.20 |
| 20 | 002250 | 联化科技 | 326,377,086.79 | 3.18 |
| 21 | 600153 | 建发股份 | 294,119,232.16 | 2.87 |
| 22 | 002081 | 金螳螂  | 285,611,745.96 | 2.78 |
| 23 | 601100 | 恒立油缸 | 249,675,645.00 | 2.43 |
| 24 | 000069 | 华侨城A | 241,474,454.35 | 2.35 |
| 25 | 600019 | 宝钢股份 | 222,985,772.14 | 2.17 |
| 26 | 002174 | 游族网络 | 213,961,581.90 | 2.08 |
| 27 | 600060 | 海信电器 | 212,959,189.34 | 2.07 |

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 | 11,566,882,069.02 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 19,579,051,386.73 |

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      | 200,980,000.00 | 2.71         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | -              | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |

|   |         |                |      |
|---|---------|----------------|------|
| 4 | 企业债券    | 51,281,119.70  | 0.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | —              | —    |
| 6 | 中期票据    | —              | —    |
| 7 | 可转债     | —              | —    |
| 8 | 其他      | —              | —    |
| 9 | 合计      | 252,261,119.70 | 3.40 |

## 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

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  | 019423 | 14 付息国债 23 | 2,000,000 | 200,980,000.00 | 2.71         |
| 2  | 112030 | 11 鲁西债     | 479,130   | 50,160,119.70  | 0.68         |
| 3  | 132002 | 15 天集 EB   | 11,210    | 1,121,000.00   | 0.02         |

## 7.7 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。

## 7.8 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持有贵金属。

## 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中，海润光伏科技股份有限公司公告，因公司涉嫌存在信息披露违法行为，于 2015 年 2 月 13 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》。本基金于 2014 年 9 月参加其定向增发，目前处于锁定期中，我们将继续密切关注证监会调查的后续进展。

除上述情况外，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   | 10,715,775.55  |
| 2  | 应收证券清算款 | 139,297,947.32 |
| 3  | 应收股利    | —              |
| 4  | 应收利息    | 8,497,282.05   |
| 5  | 应收申购款   | 6,944,370.40   |
| 6  | 其他应收款   | —              |
| 7  | 待摊费用    | —              |
| 8  | 其他      | —              |
| 9  | 合计      | 165,455,375.32 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 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  | 600401 | *ST 海润 | 206,165,400.00 | 2.78         | 非公开发行    |
| 2  | 000050 | 深天马 A  | 152,186,197.39 | 2.05         | 非公开发行    |
| 3  | 300336 | 新文化    | 43,718,400.00  | 0.59         | 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额             | 占总份<br>额比例 |
| 186,058      | 25,291.76     | 396,309,930.43 | 8.42%      | 4,309,423,843.14 | 91.58%     |

### 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<br>比例 |
|----|-------|--------------|--------------|
| 1  | 黄建鹏   | 1,720,000.00 | 1.26%        |
| 2  | 王慧敏   | 1,070,641.00 | 0.79%        |
| 3  | 徐慧均   | 1,000,000.00 | 0.73%        |
| 4  | 陈振宇   | 988,100.00   | 0.72%        |
| 5  | 李丽群   | 870,393.00   | 0.64%        |
| 6  | 侯宝柱   | 850,000.00   | 0.62%        |
| 7  | 陶隽    | 763,813.00   | 0.56%        |
| 8  | 叶风    | 741,800.00   | 0.54%        |
| 9  | 江升    | 638,081.00   | 0.47%        |
| 10 | 杨喜梅   | 530,800.00   | 0.39%        |

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 | 1,862,342.52 | 0.0396% |
|------------------|--------------|---------|

#### 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 | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | >100              |

注：本基金的基金经理之一也是本公司投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2005 年 11 月 3 日）基金份额总额 | 927,645,098.72   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 8,383,887,073.21 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 1,397,652,173.78 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 5,075,805,473.42 |
| 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                   | 4,705,733,773.57 |

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。

2015 年 3 月 26 日公告，公司副总经理徐天舒于 2015 年 3 月 24 日起离任；

2015 年 4 月 30 日公告，公司副总经理董承非于 2015 年 4 月 30 日起任职，公司副总经理杜昌勇于 2015 年 4 月 30 日起离任；

2015 年 6 月 4 日公告，公司副总经理傅鹏博于 2015 年 6 月 4 日起任职。

（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 |    |
| 兴业证券 | 2      | 11,059,954,899.93 | 37.00%       | 7,949,978.57 | 34.72%     | -  |
| 海通证券 | 2      | 5,871,069,985.65  | 19.64%       | 4,785,857.00 | 20.90%     | -  |
| 安信证券 | 2      | 3,672,388,049.30  | 12.28%       | 2,528,996.99 | 11.05%     | -  |
| 中信建投 | 2      | 2,630,854,125.60  | 8.80%        | 2,095,572.97 | 9.15%      | -  |
| 中信证券 | 3      | 2,239,419,188.72  | 7.49%        | 1,511,009.86 | 6.60%      | -  |
| 东方证券 | 1      | 1,808,165,847.79  | 6.05%        | 1,646,160.42 | 7.19%      | -  |
| 华泰证券 | 1      | 1,136,656,059.08  | 3.80%        | 1,034,811.68 | 4.52%      | -  |
| 光大证券 | 1      | 593,846,872.89    | 1.99%        | 540,635.81   | 2.36%      | -  |
| 国金证券 | 1      | 351,046,671.86    | 1.17%        | 319,593.04   | 1.40%      | -  |

|      |   |                |       |            |       |   |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 民生证券 | 2 | 204,638,386.27 | 0.68% | 186,302.34 | 0.81% | - |
| 申万宏源 | 1 | 135,580,510.70 | 0.45% | 123,431.51 | 0.54% | - |
| 招商证券 | 1 | 115,587,862.89 | 0.39% | 105,230.43 | 0.46% | - |
| 东北证券 | 2 | 74,289,391.54  | 0.25% | 67,632.72  | 0.30% | - |
| 中金公司 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国元证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 金元证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 民族证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 广发证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |
| 国海证券 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |

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 |
| 兴业证券 | 18,549,233.33  | 9.57%        | 450,000,000.00 | 41.10%         | -    | -            |
| 海通证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中信证券 | 175,181,821.20 | 90.43%       | 50,000,000.00  | 4.57%          | -    | -            |
| 东方证券 | -              | -            | 544,900,000.00 | 49.77%         | -    | -            |
| 华泰证券 | -              | -            | 50,000,000.00  | 4.57%          | -    | -            |
| 光大证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 申万宏源 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 招商证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东北证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 国元证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 金元证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 民族证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -              | -            | -              | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|
| 国海证券 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

## 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 2014 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 | 2015 年 1 月 1 日  |
| 2  | 关于解聘兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 1 月 5 日  |
| 3  | 兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）分红公告（第九次）   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 1 月 7 日  |
| 4  | 关于长期停牌股票（抚顺特钢）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 1 月 14 日 |
| 5  | 关于长期停牌股票（新华保险）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 1 月 21 日 |
| 6  | 关于长期停牌股票（西藏旅游）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 1 月 23 日 |
| 7  | 关于长期停牌股票（华星创业）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 1 月 29 日 |
| 8  | 关于增加联讯证券有限责任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 | 2015 年 2 月 3 日  |
| 9  | 关于旗下部分基金投资新文化（300336）非公开发行的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 2 月 12 日 |
| 10 | 关于长期停牌股票（万丰奥威）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 2 月 28 日 |
| 11 | 关于长期停牌股票（长安汽车）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 18 日 |
| 12 | 关于长期停牌股票（久其软件）估值方法调整的公告         | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 24 日 |
| 13 | 关于长期停牌股票（盛运股份）估值方法调             | 中国证券报、上海         | 2015 年 3 月 26 日 |

|    |                                        |                      |                 |
|----|----------------------------------------|----------------------|-----------------|
|    | 整的公告                                   | 证券报、证券时报             |                 |
| 14 | 关于副总经理离任的公告                            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 26 日 |
| 15 | 关于继续参加工商银行个人电子银行基金<br>申购费率优惠活动的公告      | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 28 日 |
| 16 | 关于旗下基金调整交易所固定收益品种估<br>值方法的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 3 月 31 日 |
| 17 | 关于长期停牌股票（三湘股份）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 1 日  |
| 18 | 关于长期停牌股票（华域汽车）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 3 日  |
| 19 | 关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 4 日  |
| 20 | 关于长期停牌股票（航天信息）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 4 日  |
| 21 | 关于长期停牌股票（骅威股份）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 4 日  |
| 22 | 关于长期停牌股票（通威股份）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 8 日  |
| 23 | 关于公司旗下部分基金投资旗滨集团<br>（601636）非公开发行股票的公告 | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 8 日  |
| 24 | 关于长期停牌股票（恒宝股份）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 9 日  |
| 25 | 关于新增 “银联通” 部分银行卡网上直销<br>业务功能及费率优惠的公告   | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 9 日  |
| 26 | 关于长期停牌股票（阳光电源）估值方法调<br>整的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 15 日 |
| 27 | 关于旗下部分基金投资绿盟科技（300369）<br>非公开发行股票的公告   | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 17 日 |

|    |                                  |                  |                 |
|----|----------------------------------|------------------|-----------------|
| 28 | 关于长期停牌股票（招商地产）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 24 日 |
| 29 | 关于长期停牌股票（华宇软件）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 25 日 |
| 30 | 关于长期停牌股票（神州信息）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 25 日 |
| 31 | 关于兴业银行电子渠道代销系统基金申购费率优惠比例调整的提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 25 日 |
| 32 | 关于增加广州证券有限责任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 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 33 | 关于通过广州证券申购或定投旗下部分基金费率优惠的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 34 | 关于副总经理变更的公告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 4 月 30 日 |
| 35 | 关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告     | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 4 日  |
| 36 | 关于长期停牌股票（瑞丰光电）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 12 日 |
| 37 | 关于长期停牌股票（南方泵业）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 13 日 |
| 38 | 关于长期停牌股票（中国国旅）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 21 日 |
| 39 | 关于长期停牌股票（一心堂）估值方法调整的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 21 日 |
| 40 | 关于长期停牌股票（网宿科技）估值方法调整的公告          | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 22 日 |
| 41 | 关于长期停牌股票（梅泰诺）估值方法调整的公告           | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 23 日 |
| 42 | 关于长期停牌股票（金螳螂）估值方法调整              | 中国证券报、上海         | 2015 年 5 月 26 日 |

|    |                                       |                      |                 |
|----|---------------------------------------|----------------------|-----------------|
|    | 的公告                                   | 证券报、证券时报             |                 |
| 43 | 关于长期停牌股票（合众思壮）估值方法调整的公告               | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 27 日 |
| 44 | 关于公司董监高及其他从业人员在子公司<br>兼职及领薪情况的公告      | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 27 日 |
| 45 | 关于长期停牌股票（中炬高新）估值方法调<br>整的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 28 日 |
| 46 | 关于长期停牌股票（新华医疗）估值方法调<br>整的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 28 日 |
| 47 | 关于长期停牌股票（比亚迪）估值方法调整<br>的公告            | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 28 日 |
| 48 | 关于开通手机客户端直销业务功能的公告                    | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 28 日 |
| 49 | 关于长期停牌股票（中材科技）估值方法调<br>整的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 5 月 29 日 |
| 50 | 关于副总经理变更的公告                           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 4 日  |
| 51 | 关于长期停牌股票（芭田股份）估值方法调<br>整的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 5 日  |
| 52 | 关于长期停牌股票（城投控股）估值方法调<br>整的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 9 日  |
| 53 | 关于旗下部分基金继续参加农业银行网上<br>银行基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 18 日 |
| 54 | 关于长期停牌股票（海南海药、新时达）估<br>值方法调整的公告       | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 20 日 |
| 55 | 关于长期停牌股票（常山药业）估值方法调<br>整的公告           | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 24 日 |
| 56 | 关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、<br>手机银行申购优惠费率的公告  | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 26 日 |



|    |                                  |                      |                 |
|----|----------------------------------|----------------------|-----------------|
| 57 | 关于长期停牌股票（华东医药、太极股份）<br>估值方法调整的公告 | 中国证券报、上海<br>证券报、证券时报 | 2015 年 6 月 30 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、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

### 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

2015 年 8 月 26 日