

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (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：中国农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。

基金托管人中国农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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
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
§4 管理人报告	7
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.....	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.....	10

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
§5 托管人报告.....	11
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的真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
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
§7 投资组合报告.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
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	42
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	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 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	526,620,244.02 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	中国农业银行股份有限公司

	姓名	冯晓莲	林葛
信息披露负责人	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	tgxxpl@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	北京东城区建国门内大街 6 9 号
办公地址		上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	北京复兴门内大街 2 8 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		200122	100031
法定代表人		兰荣	刘士余

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	http://www.xyfunds.com.cn
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(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	460,007,302.14
本期利润	301,707,262.09
加权平均基金份额本期利润	0.2958
本期加权平均净值利润率	21.31%
本期基金份额净值增长率	25.79%
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	216,843,234.48
期末可供分配基金份额利润	0.4118

期末基金资产净值	837,971,865.05
期末基金份额净值	1.5912
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	59.12%

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	-3.03%	3.38%	-7.17%	3.32%	4.14%	0.06%
过去三个月	12.78%	2.54%	9.99%	2.48%	2.79%	0.06%
过去六个月	25.79%	2.25%	25.31%	2.15%	0.48%	0.10%
过去一年	108.00%	1.83%	99.71%	1.75%	8.29%	0.08%
过去三年	96.59%	1.46%	77.25%	1.42%	19.34%	0.04%
自基金合同生效起至今	59.12%	1.35%	28.12%	1.37%	31.00%	-0.02%

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：

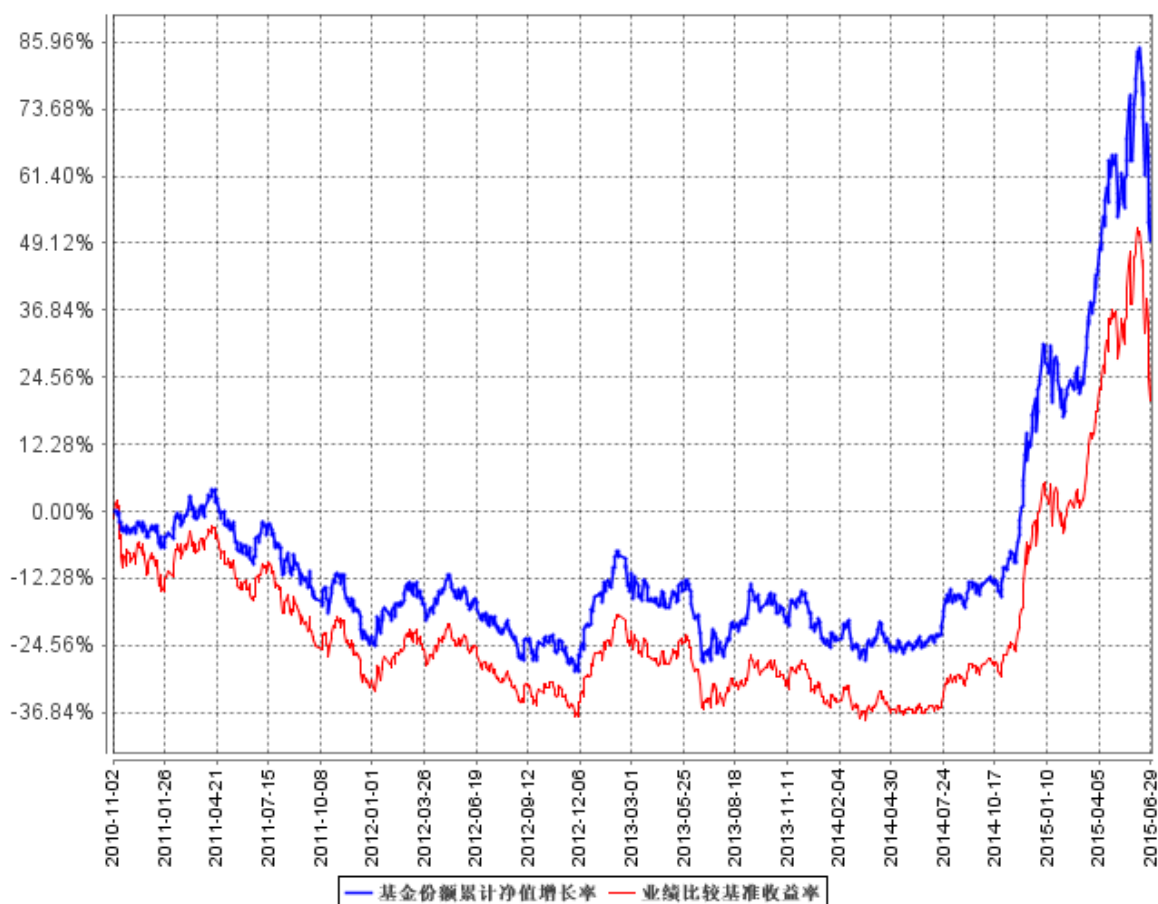
$$\text{Return}_t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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 2015 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。

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		
申庆	本基金基金经理	2010 年 11 月 2 日	-	18 年	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遵规守信情况的说明

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 A 股市场大幅波动，风格切换剧烈。大市值股票在经历去年下半年快速上涨后有所回落，但总体表现平稳，波动较小。小市值板块摆脱去年受压制的格局，经历了连续 5 个月的疯狂上涨。在六月份之后的暴跌回吐了 50% 以上的涨幅。

本基金的投资风格稳定，始终坚守价值投资的底线。面对市场疯狂炒新、炒小、炒概念的投机风，本基金没有跟风，虽然在上半年较长时间内较为被动，但从六月份开始价值投资的优势又重新得到体现。

为了尽可能弥补蓝筹股、价值股大幅落后的市场环境，本基金加强了各种套利投资，并进一步提升资金使用效率、降低交易成本、提高投资精准度。此外，本基金进一步增加了价值低估品种的配置以对冲高估值品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

上半年受市场风格切换剧烈的影响，本基金净值相对基准波动较大，但总体上报告期内基金净值与基准保持一致，并略有超额。本报告期内，本基金份额净值增长率 25.79%，同期业绩比较基准收益率 25.31%。希望在未来价值投资风格带领本基金净值实现持续超额收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

面对近年来经济下行压力较大的形势，上半年中央政府在力促转型的同时出台了一系列稳增长政策。6 月份货币信贷数据出现低位反弹，社会融资、M2、新增贷款有所超预期。7 月份的货币信贷和社会融资规模等指标较 6 月份有一定回落。在此背景下政府又开始通过发行专项金融债以加大基建投资力度。

下半年的宏观经济有望随着制造业需求改善、房地产投资企稳、经济逐步转型进一步回升。但国际环境相对较为复杂，希腊危机与乌克兰战乱在一定程度上影响了欧洲乃至全球经济复苏的步伐。

高杠杆+扭曲估值是影响当前 A 股市场及未来发展的重要因素，对此我们在一季报中已经予以充分论述。这种格局的形成与资本市场各方参与者的综合素质紧密相关。如果不从根本上解决好这些问题，很难出现持久、健康、稳定的牛市格局。倡导并坚持价值投资是规避市场风险的有效方法，更是促进资本市场长期健康发展的稳定器。

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给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。

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

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—兴业全球基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 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遵规守信、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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	25,737,706.02	14,205,988.51
结算备付金		380,196.33	1,233,099.70
存出保证金		541,282.65	186,229.01
交易性金融资产	6.4.7.2	855,042,421.74	1,855,294,704.11
其中: 股票投资		804,851,922.54	1,774,191,346.50
基金投资		-	-
债券投资		50,190,499.20	81,103,357.61
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	-	9,000,000.00
应收证券清算款		2,104,423.88	13,052,950.90
应收利息	6.4.7.5	1,772,496.16	1,685,061.79
应收股利		-	-
应收申购款		4,866,903.10	13,425,684.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		890,445,429.88	1,908,083,718.92
负债和所有者权益			
	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债:			
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		29,999,635.00	-
应付证券清算款		-	3,096,056.81
应付赎回款		20,732,555.00	25,495,060.71
应付管理人报酬		632,538.70	1,105,262.48
应付托管费		118,601.01	207,236.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	669,761.49	575,672.31
应交税费		-	-
应付利息		12,662.98	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	307,810.65	193,481.75
负债合计		52,473,564.83	30,672,770.80
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	526,620,244.02	1,484,134,190.17
未分配利润	6.4.7.10	311,351,621.03	393,276,757.95

所有者权益合计		837,971,865.05	1,877,410,948.12
负债和所有者权益总计		890,445,429.88	1,908,083,718.92

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.5912 元，基金份额总额为 526,620,244.02 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：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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		312,795,128.84	-46,657,779.16
1.利息收入		1,650,081.75	917,738.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	90,191.57	23,432.57
债券利息收入		1,425,865.78	884,413.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		134,024.40	9,892.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		467,277,656.70	2,899,387.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	460,299,682.58	-9,013,839.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-696,592.32	-120,541.47
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	7,674,566.44	12,033,768.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-158,300,040.05	-50,567,714.92
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	2,167,430.44	92,809.27
减：二、费用		11,087,866.75	5,426,517.18
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,660,995.37	3,936,546.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,061,436.61	738,102.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,531,942.73	336,580.71
5. 利息支出		492,564.07	118,281.81
其中：卖出回购金融资产支出		492,564.07	118,281.81
6. 其他费用	6.4.7.20	340,927.97	297,005.27
三、利润总额（亏损总额以“-”		301,707,262.09	-52,084,296.34

号填列)			
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		301,707,262.09	-52,084,296.34

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: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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)	1,484,134,190.17	393,276,757.95	1,877,410,948.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	301,707,262.09	301,707,262.09
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)	-957,513,946.15	-383,632,399.01	-1,341,146,345.16
其中: 1.基金申购款	656,428,329.97	236,566,825.72	892,995,155.69
2.基金赎回款	-1,613,942,276.12	-620,199,224.73	-2,234,141,500.85
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)	526,620,244.02	311,351,621.03	837,971,865.05
项目	上年度可比期间 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	18,522,775.94	-7,896,318.68	10,626,457.26

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
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

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	_____ 杨东	_____ 詹鸿飞
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) (原名兴业沪深 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。兴业沪深 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 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 2015 年 6 月 30 日
活期存款	25,737,706.02
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	25,737,706.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	538,311,601.06	804,851,922.54	266,540,321.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	67,499.20	14,499.20
	银行间市场	50,123,000.00	109,710.00
	合计	50,190,499.20	124,209.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	588,377,891.06	855,042,421.74	266,664,530.68

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 2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,312.04
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	171.10
应收债券利息	1,769,769.42
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	243.60
合计	1,772,496.16

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 2015 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	666,252.04
银行间市场应付交易费用	3,509.45
合计	669,761.49

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	55,356.21
预提费用	193,396.69
指数使用费	44,507.10
其他	14,550.65
合计	307,810.65

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	1,484,134,190.17	1,484,134,190.17
本期申购	656,428,329.97	656,428,329.97
本期赎回(以“-”号填列)	-1,613,942,276.12	-1,613,942,276.12
- 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	526,620,244.02	526,620,244.02

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	-192,769,930.14	586,046,688.09	393,276,757.95
本期利润	460,007,302.14	-158,300,040.05	301,707,262.09
本期基金份额交易产生的变动数	-50,394,137.52	-333,238,261.49	-383,632,399.01
其中：基金申购款	-22,409,967.77	258,976,793.49	236,566,825.72
基金赎回款	-27,984,169.75	-592,215,054.98	-620,199,224.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	216,843,234.48	94,508,386.55	311,351,621.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	18,279.13
其他	3,461.93
合计	90,191.57

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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	1,766,795,709.70
减：卖出股票成本总额	1,306,496,027.12
买卖股票差价收入	460,299,682.58

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 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	-696,592.32
债券投资收益——赎回差价收入	0.00
债券投资收益——申购差价收入	0.00
合计	-696,592.32

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 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	173,830,835.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	172,265,569.52
减：应收利息总额	2,261,858.26
买卖债券差价收入	-696,592.32

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

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	7,674,566.44
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,674,566.44

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-158,300,040.05
——股票投资	-158,442,921.69
——债券投资	142,881.64
——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	-158,300,040.05

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,639,516.82
转换费收入	527,913.62
合计	2,167,430.44

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

交易所市场交易费用	3,530,967.73
银行间市场交易费用	975.00
合计	3,531,942.73

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	13,700.00
银行费用	20,611.46
指数使用费	113,219.82
合计	340,927.97

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	2,025,479,688.95	94.52%	109,410,621.58	44.33%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	126,745,423.30	96.78%	2,194,702.66	11.42%

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	774,900,000.00	82.01%	5,200,000.00	3.50%

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	1,439,724.47	94.53%	666,252.04	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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
	2015年1月1日至2015年6月30日	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	5,660,995.37	3,936,546.87
其中：支付销售机构的客户维护费	1,154,819.94	1,179,304.96

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
	2015年1月1日至2015年6月30日	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	1,061,436.61	738,102.52

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**

本报告期内及上年度可比期间基金管理人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	
	2015年1月1日至2015年6月30日		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
农业银行	25,737,706.02	68,450.51	23,267,034.15	20,253.94

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（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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	39,398	564,179.36	1,844,614.36	-
300406	九强生物	2015年4月20日	2015年10月30日	新股转增	-	46.82	39,398	-	1,844,614.36	-

注 1: 本基金持有的新股九强生物, 于 2015 年 4 月 20 日实施 2014 年度权益分配方案, 向全体股东每 10 股派 5 元 (含税); 同时, 以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股。本基金新增 39,398 股。

注 2: 上述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。

6.4.12.2 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
000024	招商地产	2015 年 4 月 3 日	重大事项停牌	36.49	-	-	338,875	5,231,059.95	12,365,548.75	-
600900	长江电力	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	14.35	-	-	541,102	4,268,168.17	7,764,813.70	-
000917	电广传媒	2015 年 5 月 28 日	重大事项停牌	42.89	-	-	85,953	1,473,322.52	3,686,524.17	-
600153	建发股份	2015 年 6 月 29 日	重大事项停牌	17.51	-	-	170,000	1,699,658.64	2,976,700.00	-
000778	新兴铸管	2015 年 6 月 15 日	重大事项停牌	12.96	-	-	194,918	987,497.99	2,526,137.28	-
000793	华闻传媒	2015 年 5 月 26 日	重大事项停牌	20.75	-	-	112,493	1,297,949.53	2,334,229.75	-
601111	中国国航	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	15.36	2015 年 7 月 29 日	13.78	151,146	1,060,245.29	2,321,602.56	-
000630	铜陵有色	2015 年 3 月 9 日	重大事项停牌	8.44	-	-	267,298	2,312,652.34	2,255,995.12	-
000709	河北钢铁	2015 年 6 月 30 日	重大事项停牌	7.00	2015 年 8 月 24 日	6.30	318,000	1,045,633.04	2,226,000.00	-
000839	中信国安	2015 年 6 月 29 日	重大事项停牌	23.57	-	-	80,758	782,790.71	1,903,466.06	-
002310	东方	2015	重大	38.30	-	-	43,800	730,000.00	1,677,540.00	-

	园林	年 5 月 27 日	事项停牌							
000878	云南铜业	2015 年 6 月 8 日	重大事项停牌	24.50	-	-	58,434	857,307.61	1,431,633.00	-
000963	华东医药	2015 年 6 月 26 日	重大事项停牌	62.50	2015 年 8 月 5 日	69.20	18,896	1,192,121.08	1,181,000.00	-
002375	亚厦股份	2015 年 6 月 17 日	筹划员工持股计划	29.21	2015 年 7 月 20 日	26.29	35,559	437,546.10	1,038,678.39	-
600395	盘江股份	2015 年 6 月 8 日	重大事项停牌	15.71	2015 年 8 月 19 日	14.00	41,100	555,435.90	645,681.00	-
002001	新和成	2015 年 6 月 30 日	筹划员工持股计划	17.09	2015 年 7 月 13 日	18.49	37,714	466,039.93	644,532.26	-

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 2015 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 29,999,635.00 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
140444	14 农发 44	2015 年 7 月 1 日	100.35	100,000	10,035,000.00
120229	12 国开 29	2015 年 7 月 1 日	100.03	100,000	10,003,000.00
140218	14 国开 18	2015 年 7 月 7 日	100.05	100,000	10,005,000.00
合计				300,000	30,043,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金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 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	25,737,706.02	-	-	-	-	-	25,737,706.02
结算备付金	380,196.33	-	-	-	-	-	380,196.33
存出保证金	541,282.65	-	-	-	-	-	541,282.65
交易性金融资产	20,008,000.00	30,115,000.00	-	21,000.00	46,499.20	804,851,922.54	855,042,421.74
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,104,423.88	2,104,423.88
应收利息	-	-	-	-	-	1,772,496.16	1,772,496.16
应收申购款	173,141.52	-	-	-	-	4,693,761.58	4,866,903.10
资产总计	46,840,326.52	30,115,000.00	-	21,000.00	46,499.20	813,422,604.16	890,445,429.88
负债							
卖出回购金融资产款	29,999,635.00	-	-	-	-	-	29,999,635.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,732,555.00	20,732,555.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	632,538.70	632,538.70
应付托管费	-	-	-	-	-	118,601.01	118,601.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	669,761.49	669,761.49
应付利息	-	-	-	-	-	12,662.98	12,662.98
其他负债	-	-	-	-	-	307,810.65	307,810.65
负债总计	29,999,635.00	-	-	-	-	22,473,929.83	52,473,564.83
利率敏感度缺口	16,840,691.52	30,115,000.00	-	21,000.00	46,499.20	790,948,674.33	837,971,865.05
上年度末 2014 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	14,205,988.51	-	-	-	-	-	14,205,988.51
结算备付金	1,233,099.70	-	-	-	-	-	1,233,099.70
存出保证金	186,229.01	-	-	-	-	-	186,229.01
交易性金融资产	-	20,026,357.61	59,981,000.00	1,096,000.00	-	1,774,191,346.50	1,855,294,704.11
买入返售金融资产	9,000,000.00	-	-	-	-	-	9,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	13,052,950.90	13,052,950.90
应收利息	-	-	-	-	-	1,685,061.79	1,685,061.79
应收申购款	211,921.36	-	-	-	-	13,213,763.54	13,425,684.90
资产总计	24,837,238.58	20,026,357.61	59,981,000.00	1,096,000.00	-	1,802,143,122.73	1,908,083,718.92
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,096,056.81	3,096,056.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	25,495,060.71	25,495,060.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,105,262.48	1,105,262.48
应付托管费	-	-	-	-	-	207,236.74	207,236.74
应付交易费用	-	-	-	-	-	575,672.31	575,672.31

其他负债	-	-	-	-	193,481.75	193,481.75
负债总计	-	-	-	-	30,672,770.80	30,672,770.80
利率敏感度缺口	24,837,238.58	20,026,357.61	59,981,000.00	1,096,000.00	-1,771,470,351.93	1,877,410,948.12

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%	-64,770.71	-398,952.19
	利率 -1%	65,011.73	403,467.41

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 2015 年 6 月 30 日		上年度末 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	804,851,922.54	96.05	1,774,191,346.50	94.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	50,190,499.20	5.99	81,103,357.61	4.32
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	855,042,421.74	102.04	1,855,294,704.11	98.82

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%	82,846,243.10	204,994,866.19
	业绩比较基准 -10%	-82,846,243.10	-204,994,866.19

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	804,851,922.54	90.39
	其中：股票	804,851,922.54	90.39
2	固定收益投资	50,190,499.20	5.64
	其中：债券	50,190,499.20	5.64
	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	26,117,902.35	2.93
7	其他各项资产	9,285,105.79	1.04
8	合计	890,445,429.88	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	600,883.20	0.07
B	采矿业	58,956,016.50	7.04
C	制造业	220,102,452.37	26.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,610,504.87	3.18
E	建筑业	34,922,092.82	4.17
F	批发和零售业	20,583,419.11	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	28,491,000.14	3.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,689,528.15	2.71
J	金融业	289,249,627.38	34.52
K	房地产业	43,068,781.20	5.14
L	租赁和商务服务业	12,136,943.00	1.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,634,400.00	0.43

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	5,975,467.08	0.71
S	综合	-	-
	合计	767,021,115.82	91.53

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	6,218,361.00	0.74
C	制造业	28,889,993.72	3.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	248,330.00	0.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,199,402.00	0.26
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	-	-
J	金融业	274,720.00	0.03
K	房地产业	-	-
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	37,830,806.72	4.51

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	760,000	62,274,400.00	7.43
2	600036	招商银行	1,670,000	31,262,400.00	3.73
3	601166	兴业银行	1,318,600	22,745,850.00	2.71
4	601601	中国太保	658,000	19,858,440.00	2.37
5	600000	浦发银行	1,080,000	18,316,800.00	2.19
6	000895	双汇发展	769,700	16,417,701.00	1.96
7	601328	交通银行	1,980,000	16,315,200.00	1.95
8	600030	中信证券	600,000	16,146,000.00	1.93
9	600016	民生银行	1,307,328	12,994,840.32	1.55
10	600741	华域汽车	580,000	12,383,000.00	1.48
11	000024	招商地产	338,875	12,365,548.75	1.48
12	000002	万科 A	800,000	11,616,000.00	1.39
13	600690	青岛海尔	358,000	10,858,140.00	1.30
14	601988	中国银行	2,208,900	10,801,521.00	1.29
15	601668	中国建筑	1,280,000	10,636,800.00	1.27
16	601818	光大银行	1,880,000	10,076,800.00	1.20
17	601006	大秦铁路	680,000	9,547,200.00	1.14
18	600519	贵州茅台	37,000	9,533,050.00	1.14
19	600104	上汽集团	410,800	9,284,080.00	1.11
20	000800	一汽轿车	358,000	8,907,040.00	1.06
21	601989	中国重工	600,000	8,880,000.00	1.06
22	601088	中国神华	416,200	8,677,770.00	1.04
23	000001	平安银行	580,000	8,433,200.00	1.01
24	601169	北京银行	624,600	8,319,672.00	0.99
25	601699	潞安环能	824,850	7,976,299.50	0.95
26	600900	长江电力	541,102	7,764,813.70	0.93
27	600048	保利地产	644,000	7,354,480.00	0.88
28	601888	中国国旅	104,542	6,931,134.60	0.83
29	600015	华夏银行	440,203	6,695,487.63	0.80
30	000983	西山煤电	686,508	6,508,095.84	0.78
31	600348	阳泉煤业	567,777	5,819,714.25	0.69
32	002024	苏宁云商	378,400	5,789,520.00	0.69
33	600050	中国联通	786,100	5,762,113.00	0.69
34	601009	南京银行	247,300	5,638,440.00	0.67
35	000937	冀中能源	677,950	5,437,159.00	0.65
36	600028	中国石化	761,085	5,373,260.10	0.64
37	000792	盐湖股份	188,000	5,335,440.00	0.64
38	000776	广发证券	229,299	5,193,622.35	0.62
39	000858	五粮液	161,600	5,122,720.00	0.61

40	601688	华泰证券	218,000	5,042,340.00	0.60
41	600795	国电电力	700,000	4,879,000.00	0.58
42	600637	百视通	114,601	4,822,410.08	0.58
43	601398	工商银行	880,000	4,646,400.00	0.55
44	601857	中国石油	407,185	4,613,406.05	0.55
45	600585	海螺水泥	210,328	4,511,535.60	0.54
46	000625	长安汽车	200,000	4,230,000.00	0.50
47	600011	华能国际	300,000	4,209,000.00	0.50
48	601336	新华保险	68,000	4,152,080.00	0.50
49	000063	中兴通讯	173,701	4,135,820.81	0.49
50	601939	建设银行	580,000	4,135,400.00	0.49
51	600019	宝钢股份	464,900	4,063,226.00	0.48
52	601628	中国人寿	128,000	4,008,960.00	0.48
53	600649	城投控股	278,939	3,958,144.41	0.47
54	000100	TCL 集团	700,000	3,955,000.00	0.47
55	601607	上海医药	174,600	3,888,342.00	0.46
56	601186	中国铁建	246,270	3,849,200.10	0.46
57	000917	电广传媒	85,953	3,686,524.17	0.44
58	000069	华侨城 A	280,000	3,634,400.00	0.43
59	600100	同方股份	170,506	3,578,920.94	0.43
60	600089	特变电工	241,309	3,573,786.29	0.43
61	600276	恒瑞医药	80,003	3,563,333.62	0.43
62	600383	金地集团	280,000	3,542,000.00	0.42
63	601618	中国中冶	475,600	3,438,588.00	0.41
64	600221	海南航空	528,700	3,378,393.00	0.40
65	600177	雅戈尔	183,846	3,357,027.96	0.40
66	601899	紫金矿业	637,933	3,266,216.96	0.39
67	000157	中联重科	401,686	3,257,673.46	0.39
68	600009	上海机场	101,035	3,202,809.50	0.38
69	600588	用友网络	69,600	3,193,248.00	0.38
70	600309	万华化学	130,058	3,144,802.44	0.38
71	600150	中国船舶	58,500	3,012,750.00	0.36
72	600153	建发股份	170,000	2,976,700.00	0.36
73	600839	四川长虹	300,000	2,952,000.00	0.35
74	600415	小商品城	188,000	2,872,640.00	0.34
75	002008	大族激光	100,000	2,872,000.00	0.34
76	600873	梅花生物	273,653	2,856,937.32	0.34
77	000338	潍柴动力	90,028	2,850,286.48	0.34
78	000333	美的集团	75,864	2,828,209.92	0.34

79	600893	中航动力	53,000	2,816,950.00	0.34
80	600739	辽宁成大	115,025	2,812,361.25	0.34
81	601669	中国电建	248,000	2,812,320.00	0.34
82	600196	复星医药	94,647	2,739,084.18	0.33
83	600115	东方航空	221,514	2,729,052.48	0.33
84	000039	中集集团	84,362	2,724,892.60	0.33
85	600597	光明乳业	116,593	2,681,639.00	0.32
86	000402	金融街	187,500	2,649,375.00	0.32
87	000728	国元证券	69,270	2,630,874.60	0.31
88	000999	华润三九	83,571	2,539,722.69	0.30
89	000778	新兴铸管	194,918	2,526,137.28	0.30
90	600068	葛洲坝	215,905	2,523,929.45	0.30
91	600352	浙江龙盛	173,804	2,462,802.68	0.29
92	000423	东阿阿胶	45,031	2,454,189.50	0.29
93	600583	海油工程	145,800	2,429,028.00	0.29
94	000629	攀钢钒钛	451,410	2,419,557.60	0.29
95	000793	华闻传媒	112,493	2,334,229.75	0.28
96	000061	农产品	114,371	2,333,168.40	0.28
97	601111	中国国航	151,146	2,321,602.56	0.28
98	002594	比亚迪	41,500	2,292,045.00	0.27
99	000768	中航飞机	52,159	2,273,089.22	0.27
100	000630	铜陵有色	267,298	2,255,995.12	0.27
101	002081	金螳螂	80,000	2,255,200.00	0.27
102	600827	百联股份	108,083	2,249,207.23	0.27
103	000709	河北钢铁	318,000	2,226,000.00	0.27
104	601333	广深铁路	268,000	2,202,960.00	0.26
105	601998	中信银行	284,318	2,192,091.78	0.26
106	601800	中国交建	120,052	2,108,113.12	0.25
107	000623	吉林敖东	61,900	2,079,840.00	0.25
108	601866	中海集运	218,800	2,078,600.00	0.25
109	600029	南方航空	142,562	2,072,851.48	0.25
110	600315	上海家化	47,584	2,065,145.60	0.25
111	600170	上海建工	218,300	2,047,654.00	0.24
112	600516	方大炭素	171,384	2,041,183.44	0.24
113	601992	金隅股份	168,000	2,007,600.00	0.24
114	002142	宁波银行	92,200	1,950,030.00	0.23
115	600688	上海石化	180,809	1,940,080.57	0.23
116	000581	威孚高科	62,442	1,935,077.58	0.23
117	600642	申能股份	191,175	1,913,661.75	0.23

118	000839	中信国安	80,758	1,903,466.06	0.23
119	000568	泸州老窖	58,000	1,891,380.00	0.23
120	600718	东软集团	87,000	1,890,510.00	0.23
121	600118	中国卫星	32,303	1,839,978.88	0.22
122	601898	中煤能源	160,228	1,829,803.76	0.22
123	600863	内蒙华电	220,000	1,799,600.00	0.21
124	601117	中国化学	176,445	1,725,632.10	0.21
125	600600	青岛啤酒	36,975	1,722,665.25	0.21
126	002310	东方园林	43,800	1,677,540.00	0.20
127	000425	徐工机械	125,991	1,671,900.57	0.20
128	000686	东北证券	84,900	1,653,003.00	0.20
129	601098	中南传媒	69,793	1,598,957.63	0.19
130	600208	新湖中宝	205,082	1,583,233.04	0.19
131	600252	中恒集团	68,000	1,564,000.00	0.19
132	600362	江西铜业	71,822	1,544,891.22	0.18
133	000651	格力电器	23,809	1,521,395.10	0.18
134	600369	西南证券	76,262	1,498,548.30	0.18
135	000876	新希望	76,913	1,492,881.33	0.18
136	600547	山东黄金	60,408	1,492,077.60	0.18
137	600060	海信电器	59,501	1,463,129.59	0.17
138	000878	云南铜业	58,434	1,431,633.00	0.17
139	000400	许继电气	56,834	1,429,943.44	0.17
140	600660	福耀玻璃	100,000	1,428,000.00	0.17
141	600166	福田汽车	160,813	1,419,978.79	0.17
142	601258	庞大集团	244,354	1,334,172.84	0.16
143	000027	深圳能源	106,452	1,314,682.20	0.16
144	600578	京能电力	146,442	1,307,727.06	0.16
145	000898	鞍钢股份	169,487	1,237,255.10	0.15
146	601928	凤凰传媒	72,107	1,233,029.70	0.15
147	000729	燕京啤酒	118,300	1,230,320.00	0.15
148	002570	贝因美	62,435	1,211,863.35	0.14
149	002007	华兰生物	27,200	1,204,688.00	0.14
150	000963	华东医药	18,896	1,181,000.00	0.14
151	000750	国海证券	70,073	1,177,226.40	0.14
152	600038	中直股份	18,668	1,156,482.60	0.14
153	601158	重庆水务	103,328	1,109,742.72	0.13
154	600837	海通证券	50,000	1,090,000.00	0.13
155	002375	亚厦股份	35,559	1,038,678.39	0.12
156	600316	洪都航空	29,194	1,009,528.52	0.12

157	601018	宁波港	108,318	957,531.12	0.11
158	600256	广汇能源	90,114	937,185.60	0.11
159	600875	东方电气	42,916	878,490.52	0.10
160	300251	光线传媒	32,500	809,250.00	0.10
161	002051	中工国际	27,147	808,437.66	0.10
162	600008	首创股份	53,783	771,786.05	0.09
163	600023	浙能电力	70,011	694,509.12	0.08
164	600497	驰宏锌锗	46,352	676,275.68	0.08
165	000825	太钢不锈	92,105	654,866.55	0.08
166	002001	新和成	37,714	644,532.26	0.08
167	600031	三一重工	62,850	609,016.50	0.07
168	000725	京东方 A	117,170	608,112.30	0.07
169	601118	海南橡胶	61,440	600,883.20	0.07
170	600157	永泰能源	85,823	590,462.24	0.07
171	603000	人民网	10,905	568,477.65	0.07
172	600809	山西汾酒	19,980	564,235.20	0.07
173	600674	川投能源	40,000	500,400.00	0.06
174	600188	兖州煤业	36,118	496,622.50	0.06
175	002236	大华股份	14,900	475,608.00	0.06
176	601231	环旭电子	27,200	462,672.00	0.06
177	601225	陕西煤业	50,499	413,081.82	0.05
178	600804	鹏博士	12,041	359,544.26	0.04
179	601933	永辉超市	30,381	352,115.79	0.04
180	000598	兴蓉环境	36,111	345,582.27	0.04
181	002410	广联达	11,600	271,440.00	0.03
182	000538	云南白药	2,400	207,048.00	0.02
183	601929	吉视传媒	11,864	179,383.68	0.02
184	002065	东华软件	1,823	52,411.25	0.01

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	000919	金陵药业	487,000	9,486,760.00	1.13
2	600664	哈药股份	627,000	7,549,080.00	0.90
3	000933	神火股份	458,000	4,314,360.00	0.51
4	600123	兰花科创	358,000	4,210,080.00	0.50
5	300406	九强生物	78,796	3,689,228.72	0.44

6	601666	平煤股份	180,000	1,362,600.00	0.16
7	600835	上海机电	38,000	1,251,720.00	0.15
8	600546	山煤国际	130,200	1,108,002.00	0.13
9	600655	豫园商城	68,000	1,091,400.00	0.13
10	600498	烽火通信	38,000	1,005,480.00	0.12
11	600062	华润双鹤	37,000	963,480.00	0.12
12	600395	盘江股份	41,100	645,681.00	0.08
13	000401	冀东水泥	47,900	629,885.00	0.08
14	601211	国泰君安	8,000	274,720.00	0.03
15	601985	中国核电	19,000	248,330.00	0.03

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	600016	民生银行	76,456,329.76	4.07
2	600028	中国石化	36,986,731.52	1.97
3	601318	中国平安	35,924,498.70	1.91
4	601231	环旭电子	25,823,000.00	1.38
5	601601	中国太保	24,483,128.47	1.30
6	601988	中国银行	23,868,183.94	1.27
7	600795	国电电力	18,203,539.79	0.97
8	600036	招商银行	17,471,082.78	0.93
9	600000	浦发银行	15,044,552.00	0.80
10	002594	比亚迪	13,612,000.00	0.73
11	601328	交通银行	8,810,133.83	0.47
12	000895	双汇发展	8,808,626.28	0.47
13	601006	大秦铁路	7,944,137.00	0.42
14	601398	工商银行	7,742,740.00	0.41
15	601166	兴业银行	7,449,904.00	0.40
16	000750	国海证券	6,321,797.00	0.34
17	601939	建设银行	6,144,773.00	0.33
18	601818	光大银行	5,844,590.00	0.31
19	601628	中国人寿	4,846,569.00	0.26
20	600348	阳泉煤业	4,408,940.00	0.23

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	120,358,594.20	6.41
2	600016	民生银行	113,193,328.94	6.03
3	600036	招商银行	61,414,835.30	3.27
4	600000	浦发银行	51,681,719.90	2.75
5	601601	中国太保	45,032,794.27	2.40
6	601166	兴业银行	41,577,721.11	2.21
7	600028	中国石化	40,585,578.53	2.16
8	600153	建发股份	39,832,103.90	2.12
9	601328	交通银行	33,657,712.87	1.79
10	000895	双汇发展	33,462,847.58	1.78
11	600837	海通证券	31,227,886.69	1.66
12	600795	国电电力	30,320,988.83	1.62
13	600030	中信证券	27,981,405.72	1.49
14	601390	中国中铁	27,873,444.91	1.48
15	601231	环旭电子	26,558,899.71	1.41
16	000002	万科A	26,322,787.39	1.40
17	600741	华域汽车	24,559,665.81	1.31
18	601088	中国神华	24,483,176.52	1.30
19	601988	中国银行	22,817,692.18	1.22
20	600104	上汽集团	22,534,208.20	1.20

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	495,599,524.85
卖出股票收入（成交）总额	1,766,795,709.70

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	50,123,000.00	5.98
	其中：政策性金融债	50,123,000.00	5.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	67,499.20	0.01
8	其他	-	-
9	合计	50,190,499.20	5.99

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	140223	14 国开 23	200,000	20,080,000.00	2.40
2	140444	14 农发 44	100,000	10,035,000.00	1.20
3	140218	14 国开 18	100,000	10,005,000.00	1.19
4	120229	12 国开 29	100,000	10,003,000.00	1.19
5	110031	航信转债	320	46,499.20	0.01

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	541,282.65
2	应收证券清算款	2,104,423.88
3	应收股利	-
4	应收利息	1,772,496.16
5	应收申购款	4,866,903.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,285,105.79

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

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	300406	九强生物	3,689,228.72	0.44	新股锁定

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
15,962	32,992.12	192,405,435.82	36.54%	334,214,808.20	63.46%

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	周素菊	416,623.00	7.40%
2	王乐京	303,442.00	5.39%
3	程功义	295,800.00	5.25%
4	王小平	180,000.00	3.20%
5	曾武彬	131,600.00	2.34%
6	冯学正	124,826.00	2.22%
7	陈敏丽	105,400.00	1.87%
8	王林妹	100,020.00	1.78%
9	刘秀兰	100,000.00	1.78%
10	夏永强	80,006.00	1.42%

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	1,312,962.24	0.2493%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 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	1,484,134,190.17
本报告期基金总申购份额	656,428,329.97
减:本报告期基金总赎回份额	1,613,942,276.12
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	526,620,244.02

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	2,025,479,688.95	94.52%	1,439,724.47	94.53%	-
民族证券	1	117,340,821.42	5.48%	83,358.37	5.47%	-

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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比例		券回购成交总额的比例		成交总额的比例
兴业证券	126,745,423.30	96.78%	774,900,000.00	82.01%	-	-
民族证券	4,212,530.10	3.22%	170,000,000.00	17.99%	-	-

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
3	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
4	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
5	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
6	关于参加浦发银行基金定投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	2015 年 2 月 2 日
7	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
8	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
9	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
10	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
11	关于长期停牌股票（盛运股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 26 日
12	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	2015 年 3 月 26 日
13	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	2015 年 3 月 28 日
14	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 31 日
15	关于长期停牌股票（三湘股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 1 日
16	关于长期停牌股票（华域汽车）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 4 月 3 日
17	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法	中国证券报、上海证	2015 年 4 月 4 日

	调整的公告	券报、证券时报	
18	关于长期停牌股票（航天信息）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 4 日
19	关于长期停牌股票（骅威股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 4 日
20	关于长期停牌股票（通威股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 8 日
21	关于长期停牌股票（恒宝股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 9 日
22	关于新增“银联通”部分银行卡网上直销业务功能及费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 9 日
23	关于长期停牌股票（阳光电源）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 15 日
24	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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	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
38	关于长期停牌股票（金螳螂）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 26 日
39	关于长期停牌股票（合众思壮）估值方法	中国证券报、上海证	2015 年 5 月 27 日

	调整的公告	券报、证券时报	
40	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 27 日
41	关于长期停牌股票（中炬高新）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 28 日
42	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	2015 年 5 月 28 日
43	关于长期停牌股票（比亚迪）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 28 日
44	关于开通手机客户端直销业务功能的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 28 日
45	关于长期停牌股票（中材科技）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 29 日
46	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 6 月 4 日
47	关于长期停牌股票（芭田股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 5 日
48	关于长期停牌股票（城投控股）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 6 月 9 日
49	关于旗下部分基金继续参加农业银行网上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	2015 年 6 月 18 日
50	关于长期停牌股票（海南海药、新时达）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 6 月 20 日
51	关于长期停牌股票（常山药业）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 6 月 24 日
52	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 26 日
53	关于长期停牌股票（华东医药、太极股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	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

2015 年 8 月 26 日