

# 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

## 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 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：2016 年 3 月 25 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 2016 年 3 月 24 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。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

### 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.9 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 .....	12
<b>§5 托管人报告.....</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	13
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 .....	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§6 审计报告.....</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息.....	13
6.2 审计报告的基本内容.....	14
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
8.3 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 .....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
8.6 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 .....	51
8.7 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 .....	52
8.8 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 .....	52
8.9 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 .....	52
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	52
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
8.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
9.4 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 .....	54
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
11.2 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 .....	55
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
11.4 基金投资策略的改变 .....	55
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
11.8 其他重大事件.....	56
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>

§13 备查文件目录.....	63
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	63

## § 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	304,018,593.33 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-01-19

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增

	强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。
--	---

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业全球基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	林葛
	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	560,228,962.97	20,010,684.16	-83,016,767.38
本期利润	205,509,776.70	620,935,743.11	-69,261,715.62
加权平均基金份额本期利润	0.3048	0.4753	-0.0448
本期加权平均净值利润率	22.11%	56.76%	-5.42%
本期基金份额净值增长率	9.51%	57.16%	-4.64%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	117,132,320.03	-192,769,930.14	-271,894,100.74
期末可供分配基金份额利润	0.3853	-0.1299	-0.1951
期末基金资产净值	421,150,913.36	1,877,410,948.12	1,121,622,580.85
期末基金份额净值	1.3853	1.2650	0.8049
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	38.53%	26.50%	-19.51%

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。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去三个月	16.77%	1.53%	15.66%	1.59%	1.11%	-0.06%
过去六个月	-12.94%	2.60%	-15.63%	2.54%	2.69%	0.06%
过去一年	9.51%	2.44%	5.72%	2.36%	3.79%	0.08%
过去三年	64.12%	1.75%	46.00%	1.70%	18.12%	0.05%
过去五年	44.00%	1.54%	19.34%	1.53%	24.66%	0.01%

自基金合同生效起至今	38.53%	1.52%	8.09%	1.53%	30.44%	-0.01%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------

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：

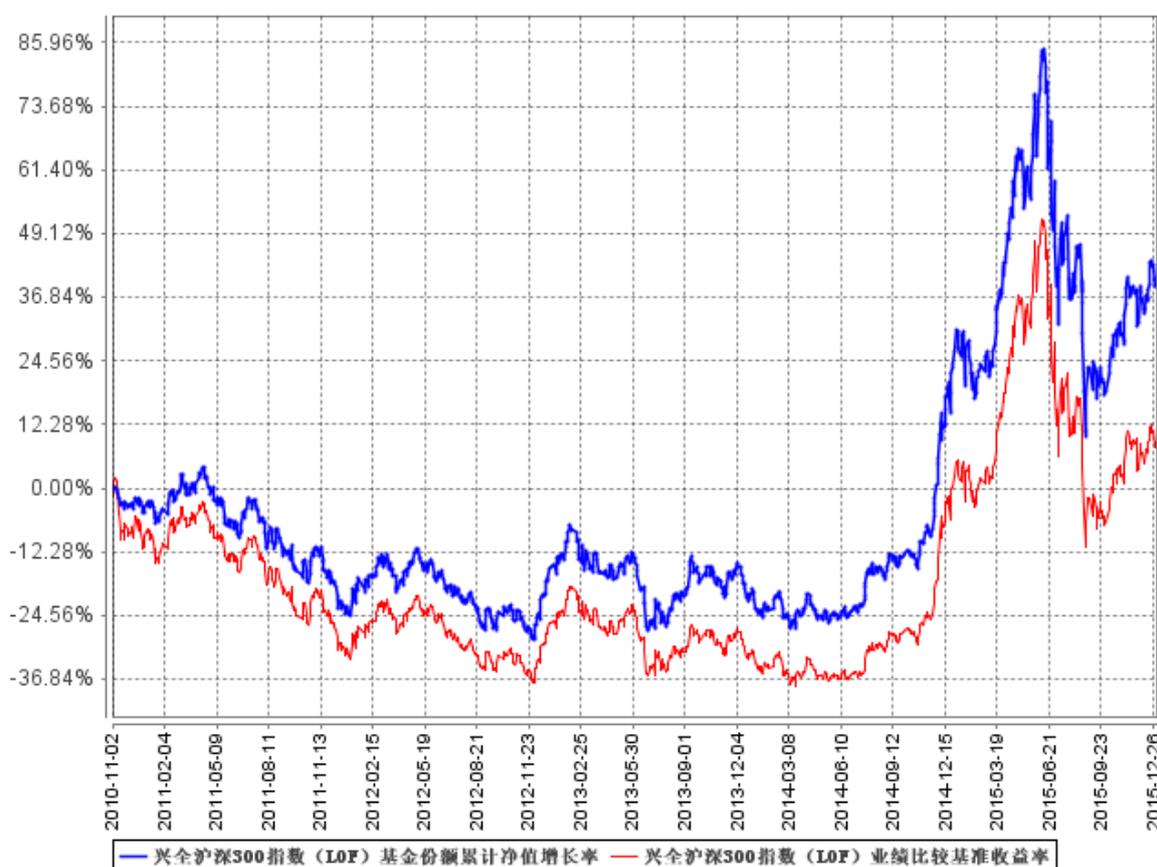
$$\text{Return } t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率 } t / 360)$$

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

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

兴全沪深300指数 (LOF) 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

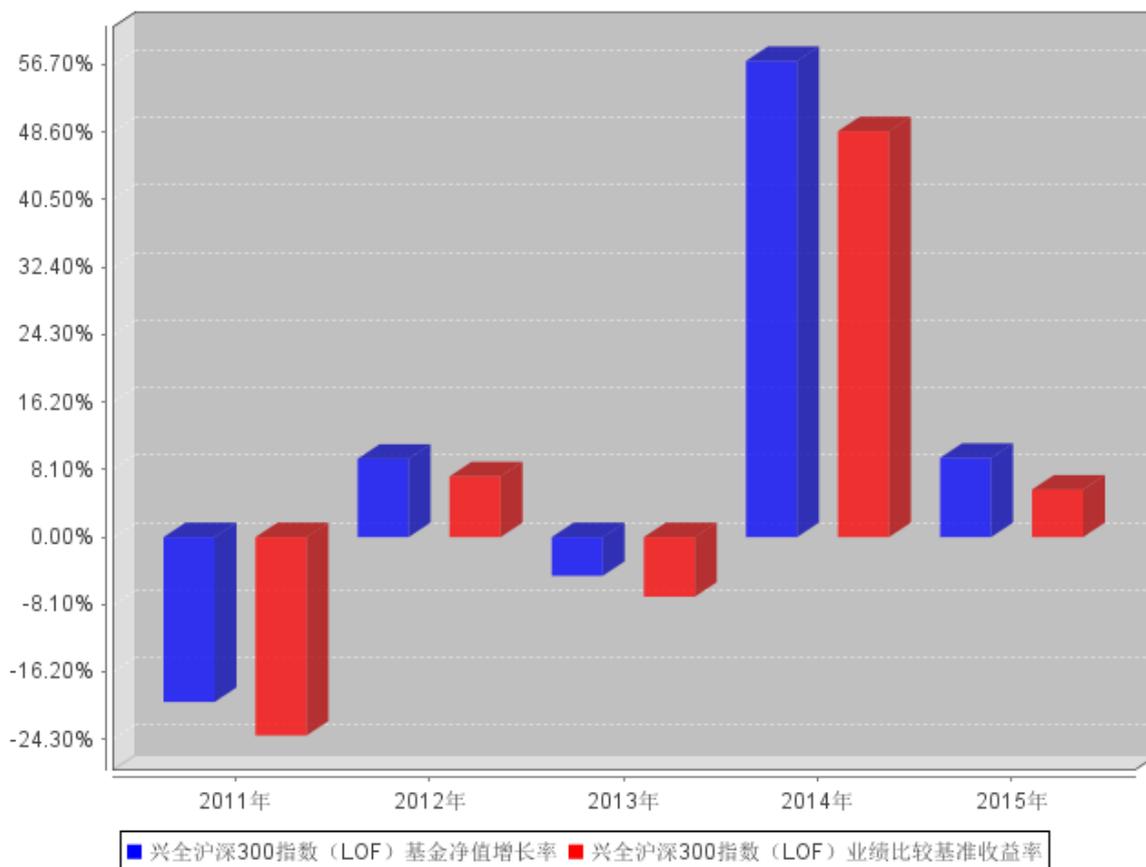


注：1、净值表现所取数据截至到 2015 年 12 月 31 日。

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。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深300指数（LOF）过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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是经中国证监会（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”。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。

截止 2015 年 12 月 31 日，公司旗下管理着十七只基金，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、兴全社会责任混合型证券投资基金、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、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、兴全绿色投资混合型证券投资基金 (LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金 (LOF)、兴全商业模式优选混合型证券投资基金 (LOF)、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

#### 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、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理	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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全沪深

300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。管理人于 2015 年 8 月 3 日收到上海证监局发出的《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求对人员行为和异常交易加强日常管理。管理人已积极整改。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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴业全球基金管理有限公司公平交易制度》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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。大市值股票总体表现平稳，波动相对较小。小市值板块一至六月上旬疯狂上涨一倍以上；六下旬至九月持续暴跌 50%左右，十月初至年底又有 40%左右的反弹。

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，净值波动较小。

为了尽可能弥补蓝筹股、价值股总体落后小市值板块的市场环境，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，本基金在高位果断兑现了显著高估的大市值公司首超额收益，进一步提升其他低估值大市值品种的配置，使得个股偏

离和行业偏离度略有提高。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金小市值板块的参与度很低，导致很难在当年如火如荼全民“抢钱”行情中获取更大的超额收益。但今年本基金的依然获取一定的超额收益。本报告期内，本基金份额净值增长率 9.51%，同期业绩比较基准收益率 5.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场在四季度形成较为明显反弹。期间创业板为代表的小市值板块反弹力度显著超过沪深 300、上证指数，相对超额达到 30%左右。许多股票再次脱离估值引力，创出历史新高。中小市值板块的总体估值水平又回到历史较高水平。此外市场对不少热点行业及公司的盈利预期存在非理性乐观。上市公司在资产重组、收购兼并过程中体现出定价不尽合理的定价和高预期。这些都为未来市场的发展埋藏隐患。

估值水平向长期合理水平回归时必然趋势。但其演化过程的确是一波三折的。本基金则坚持价值投资策略，不轻易追逐非趋势性的行业板块及市场风格的波动。

控制组合的下方风险和追求稳定的超额收益至上是本基金的核心理念。当前市场环境下应该更加注重。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及

交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

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

#### 4.8 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。

#### 4.9 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

在托管兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金的过程中, 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《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》的约定, 对兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金管理人—兴业全球基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金的投资运作、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兴全沪深 300 指数增强型证券投资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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(16)第 P0560 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (以下简称“兴全沪深 300 指数 (LOF)”) 的财务报表, 包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表, 2015 年度的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是兴全沪深 300 指数 (LOF) 基金管理人兴业全球基金管理有限公司管理层的责任, 这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为, 兴全沪深 300 指数 (LOF) 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制, 公允反映了兴全沪深 300 指数 (LOF) 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	陶坚	吴凌志
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所 (特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2016 年 3 月 24 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,931,668.02	14,205,988.51
结算备付金		174,076.13	1,233,099.70
存出保证金		344,052.21	186,229.01
交易性金融资产	7.4.7.2	418,719,129.70	1,855,294,704.11
其中：股票投资		398,634,129.70	1,774,191,346.50
基金投资		-	-
债券投资		20,085,000.00	81,103,357.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	9,000,000.00
应收证券清算款		-	13,052,950.90
应收利息	7.4.7.5	504,923.13	1,685,061.79
应收股利		-	-
应收申购款		1,083,712.72	13,425,684.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		423,757,561.91	1,908,083,718.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		62,304.31	3,096,056.81
应付赎回款		1,779,341.36	25,495,060.71
应付管理人报酬		286,800.10	1,105,262.48
应付托管费		53,775.00	207,236.74
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	48,260.36	575,672.31

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	376,167.42	193,481.75
负债合计		2,606,648.55	30,672,770.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	304,018,593.33	1,484,134,190.17
未分配利润	7.4.7.10	117,132,320.03	393,276,757.95
所有者权益合计		421,150,913.36	1,877,410,948.12
负债和所有者权益总计		423,757,561.91	1,908,083,718.92

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3853 元，基金份额总额 304,018,593.33 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		220,027,524.50	634,306,773.33
1.利息收入		2,139,823.45	2,401,235.39
其中：存款利息收入	7.4.7.11	158,476.81	137,569.24
债券利息收入		1,832,832.84	1,987,224.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		148,513.80	276,441.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		569,903,394.69	30,465,502.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	557,964,391.22	-5,206,194.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-603,302.97	6,469,079.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	12,542,306.44	29,202,616.87
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-354,719,186.27	600,925,058.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,703,492.63	514,976.55
<b>减：二、费用</b>		14,517,747.80	13,371,030.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,529,007.15	8,734,609.65
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,411,688.74	1,637,739.28
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	4,293,538.01	1,857,055.73
5. 利息支出		638,646.86	447,912.39
其中：卖出回购金融资产支出		638,646.86	447,912.39
6. 其他费用	7.4.7.20	644,867.04	693,713.17
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		205,509,776.70	620,935,743.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		205,509,776.70	620,935,743.11

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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）	-	205,509,776.70	205,509,776.70
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）	-1,180,115,596.84	-481,654,214.62	-1,661,769,811.46
其中：1. 基金申购款	780,662,512.23	284,968,789.35	1,065,631,301.58
2. 基金赎回款	-1,960,778,109.07	-766,623,003.97	-2,727,401,113.04
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	304,018,593.33	117,132,320.03	421,150,913.36

项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
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)	-	620,935,743.11	620,935,743.11
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)	90,617,508.58	44,235,115.58	134,852,624.16
其中：1. 基金申购款	1,211,034,085.36	-17,504,623.96	1,193,529,461.40
2. 基金赎回款	-1,120,416,576.78	61,739,739.54	-1,058,676,837.24
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)	1,484,134,190.17	393,276,757.95	1,877,410,948.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          兰  荣          </u>	<u>          杨  东          </u>	<u>          詹鸿飞          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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(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”)证监许可[2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准,由兴业全球基金管理有限公司作为管理人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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 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。

本基金的业绩基准为：沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具。

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法确认债券投资成本。

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

### (5) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

### 1) 股票投资

#### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值。

#### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的

估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算。

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

2) 债券投资

银行间市场交易的固定收益品种按照第三方估值机构提供估值确定公允价值；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）按照第三方估值机构提供估值确定公允价值。

对于交易所市场上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价。

未上市债券、交易所上市交易的资产支持证券及私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下或相关利率没有发生大的变动的情况下，按成本进行后续计量。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变

动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示。

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提。

(4) 买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提。

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出成交日确认,并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

(8) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 的年费率逐日计提。
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提。
- (3) 基金指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，每日计算，逐日累计，按季支付，每季度指数许可使用基点费的下限为 5 万元；
- (4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率 (当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率) 在回购期内逐日计提。
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 60%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；基金的收益分配比例应当以收益分配基准日可供分配利润为基准计算。收益分配基准日可供分配利润指收益分配基准日本基金资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；
- (3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金实施收益分配的，基金红利发放日距离收益分配基准日，即收益分配基准日可供分配利润计算截止日，不得超过 15 个工作日；
- (5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会发布的《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》(中基协发(2014)24 号)的要求,本基金本报告期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。本基金 2015 年 3 月 30 日当日进行的上述相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过 0.50%。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- 1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。
- 2) 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,暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;个人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, 其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的, 暂减按 25%计入应纳税所得额, 股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事 A 股买卖, 自 2008 年 9 月 19 日起, 出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价, 暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
活期存款	2,931,668.02	14,205,988.51
定期存款	-	-
其中: 存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计:	2,931,668.02	14,205,988.51

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末			
	2015 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	328,365,125.24	398,634,129.70	70,269,004.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	23,000.00	23,000.00	-
	银行间市场	20,085,620.00	20,062,000.00	-23,620.00
	合计	20,108,620.00	20,085,000.00	-23,620.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	348,473,745.24	418,719,129.70	70,245,384.46	

项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,349,208,103.33	1,774,191,346.50	424,983,243.17
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,096,350.05	1,096,357.61
	银行间市场	80,025,680.00	80,007,000.00
	合计	81,122,030.05	81,103,357.61
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,430,330,133.38	1,855,294,704.11	424,964,570.73

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-交易所	-	-
买入返售证券-银行间	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-交易所	9,000,000.00	-
买入返售证券-银行间	-	-
合计	9,000,000.00	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	870.84	10,122.60
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	86.13	610.39
应收债券利息	503,795.88	1,671,676.62
应收买入返售证券利息	-	2,560.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	170.28	92.18
合计	504,923.13	1,685,061.79

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	46,611.26	570,883.61
银行间市场应付交易费用	1,649.10	4,788.70
合计	48,260.36	575,672.31

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	6,750.26	26,897.11
应付指数使用费	16,866.51	52,033.99
预提审计费	48,000.00	100,000.00
预提信息披露费	290,000.00	-
其他	14,550.65	14,550.65
合计	376,167.42	193,481.75

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 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	780,662,512.23	780,662,512.23
本期赎回(以“-”号填列)	-1,960,778,109.07	-1,960,778,109.07
- 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	304,018,593.33	304,018,593.33

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	560,228,962.97	-354,719,186.27	205,509,776.70
本期基金份额交易产生的变动数	-168,834,104.17	-312,820,110.45	-481,654,214.62
其中：基金申购款	41,716,048.46	243,252,740.89	284,968,789.35
基金赎回款	-210,550,152.63	-556,072,851.34	-766,623,003.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	198,624,928.66	-81,492,608.63	117,132,320.03

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	112,110.89	113,389.60
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	21,245.55	11,144.67
其他	25,120.37	13,034.97
合计	158,476.81	137,569.24

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
卖出股票成交总额	2,162,503,846.63	711,952,974.59
减：卖出股票成本总额	1,604,539,455.41	717,159,168.65
买卖股票差价收入	557,964,391.22	-5,206,194.06

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31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	-603,302.97	6,469,079.63
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	-603,302.97	6,469,079.63

## 7.4.7.13.2 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 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	226,147,740.66	324,369,301.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	222,530,859.52	314,458,557.64
减：应收利息总额	4,220,184.11	3,441,664.00
买卖债券差价收入	-603,302.97	6,469,079.63

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	12,542,306.44	29,202,616.87
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,542,306.44	29,202,616.87

#### 7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-354,719,186.27	600,925,058.95
——股票投资	-354,714,238.71	600,700,267.67
——债券投资	-4,947.56	224,791.28
——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	-354,719,186.27	600,925,058.95

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12
----	------------------------------	--------------------------------------

	12 月 31 日	月 31 日
基金赎回费收入	2,106,049.16	459,120.89
转换费收入	596,823.72	54,555.66
其他	619.75	1,300.00
合计	2,703,492.63	514,976.55

#### 7.4.7.19 交易费用

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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,291,513.01	1,855,030.73
银行间市场交易费用	2,025.00	2,025.00
合计	4,293,538.01	1,857,055.73

#### 7.4.7.20 其他费用

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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	100,000.00
信息披露费	290,000.00	290,000.00
账户维护费用	31,700.00	18,400.00
上市费用	60,000.00	60,000.00
银行费用	29,387.81	23,279.18
指数使用费	185,579.23	202,033.99
其他	200.00	-
合计	644,867.04	693,713.17

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	2,376,842,202.15	91.37%	948,840,865.03	69.61%

##### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	127,069,445.60	96.79%	215,786,119.90	85.68%

##### 7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	885,500,000.00	78.51%	1,082,600,000.00	75.36%

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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12月31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	1,690,880.40	91.30%	44,282.88	95.00%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	675,064.10	69.64%	531,744.20	93.14%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,529,007.15	8,734,609.65
其中：支付销售机构的客户维护费	1,689,021.37	2,404,095.20

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。

#### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,411,688.74	1,637,739.28

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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	2,931,668.02	112,110.89	14,205,988.51	113,389.60

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

#### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 7.4.12 期末 (2015 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	蓝标转债	2015 年 12 月 23 日	2016 年 1 月 8 日	新债未流通	100.00	100.00	230	23,000.00	23,000.00	-

#### 7.4.12.2 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
600153	建发股份	2015 年 6 月 29 日	筹划重大事项	13.91	-	-	170,000	1,699,658.64	2,364,700.00	-
600690	青岛海尔	2015 年 10 月 19 日	筹划重大事项	9.92	2016 年 2 月 1 日	8.93	457,138	3,262,415.93	4,534,808.96	-
600649	城投控股	2015 年 12 月 30 日	筹划重大事项	23.16	2016 年 1 月 7 日	20.84	178,000	1,110,130.42	4,122,480.00	-
000002	万科 A	2015 年 12 月 18 日	筹划重大事项	24.43	-	-	139,000	2,607,640.00	3,395,770.00	注 1
000876	新希望	2015 年 8 月 17 日	筹划重大事项	18.99	2016 年 3 月 2 日	17.09	51,313	643,379.17	974,433.87	-
600873	梅花生物	2015 年 12 月 17 日	筹划重大事项	9.14	-	-	100,000	579,864.26	914,000.00	-
000712	锦龙股份	2015 年 12 月 25 日	筹划重大事项	29.12	2016 年 1 月 4 日	28.00	30,000	807,300.00	873,600.00	-
601018	宁波港	2015 年 8 月 4 日	筹划重大事项	8.16	2016 年 2 月 22 日	7.34	106,318	346,509.77	867,554.88	-
600578	京能电力	2015 年 11 月 5 日	筹划重大事项	6.07	2016 年 2 月 24 日	5.49	97,142	563,037.46	589,651.94	-
002065	东华软	2015 年 12 月 21 日	筹划重	25.10	-	-	1,823	36,747.97	45,757.30	注 2

件		大事项							
---	--	-----	--	--	--	--	--	--	--

注：1、根据上市公司公告，万 科 A 于 2015 年 12 月 18 日下午 13:00 开始停牌。

2、根据上市公司公告，东华软件于 2015 年 12 月 21 日下午 13:00 开始停牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

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

#### 7.4.13.3 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 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	2,931,668.02	-	-	-	-	-	2,931,668.02
结算备付金	174,076.13	-	-	-	-	-	174,076.13
存出保证金	344,052.21	-	-	-	-	-	344,052.21
交易性金融资产	-	-20,062,000.00	-	-23,000.00	398,634,129.70	418,719,129.70	418,719,129.70
应收利息	-	-	-	-	504,923.13	504,923.13	504,923.13
应收申购款	3,889.53	-	-	-	1,079,823.19	1,083,712.72	1,083,712.72
资产总计	3,453,685.89	-20,062,000.00	-	-23,000.00	400,218,876.02	423,757,561.91	423,757,561.91
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	62,304.31	62,304.31	62,304.31
应付赎回款	-	-	-	-	1,779,341.36	1,779,341.36	1,779,341.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	286,800.10	286,800.10	286,800.10
应付托管费	-	-	-	-	53,775.00	53,775.00	53,775.00
应付交易费用	-	-	-	-	48,260.36	48,260.36	48,260.36
其他负债	-	-	-	-	376,167.42	376,167.42	376,167.42
负债总计	-	-	-	-	2,606,648.55	2,606,648.55	2,606,648.55
利率敏感度缺口	3,453,685.89	-20,062,000.00	-	-23,000.00	397,612,227.47	421,150,913.36	421,150,913.36

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
<b>资产</b>							
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
<b>负债</b>							
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

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日)	上年度末(2014年12月31日)
	利率 +1%	-57,538.02	-398,952.19
	利率 -1%	57,875.65	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。

#### 7.4.13.4.2 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。

### 7.4.13.4.3 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：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 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	398,634,129.70	94.65	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	20,085,000.00	4.77	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	418,719,129.70	99.42	1,855,294,704.11	98.82

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日 )	上年度末 ( 2014 年 12 月 31 日 )
	业绩比较基准 +10%	30,246,747.37	204,994,866.19
	业绩比较基准 -10%	-30,246,747.37	-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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 379,951,372.75 元, 第二层次的余额为 38,767,756.95 元, 无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日: 第一层次 1,749,482,375.14 元, 第二层次的余额为 105,812,328.97 元, 无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

如本财务报告 7.4.5.2 部分所述, 本基金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除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值, 相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本年度变动金额

无。

##### (2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	398,634,129.70	94.07
	其中：股票	398,634,129.70	94.07
2	固定收益投资	20,085,000.00	4.74
	其中：债券	20,085,000.00	4.74
	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	3,105,744.15	0.73
7	其他各项资产	1,932,688.06	0.46
8	合计	423,757,561.91	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	308,750.40	0.07
B	采矿业	21,408,222.13	5.08
C	制造业	95,269,347.71	22.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,609,949.40	4.66
E	建筑业	16,798,600.07	3.99
F	批发和零售业	14,527,262.15	3.45
G	交通运输、仓储和邮政业	11,261,562.98	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,027,963.49	2.62
J	金融业	150,170,878.11	35.66

K	房地产业	28,359,290.20	6.73
L	租赁和商务服务业	6,221,370.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,640,320.00	0.39
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	4,382,451.00	1.04
S	综合	-	-
	合计	380,985,967.64	90.46

### 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,885,341.00	0.69
C	制造业	12,461,581.72	2.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	18,685.00	0.00
F	批发和零售业	282,370.00	0.07
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	2,000,184.34	0.47
J	金融业	-	-
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	17,648,162.06	4.19

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	877,000	31,572,000.00	7.50
2	600036	招商银行	877,000	15,777,230.00	3.75
3	601166	兴业银行	670,000	11,436,900.00	2.72
4	001979	招商蛇口	542,471	11,315,945.06	2.69
5	600016	民生银行	1,157,700	11,160,228.00	2.65
6	601601	中国太保	330,000	9,523,800.00	2.26
7	000895	双汇发展	450,000	9,184,500.00	2.18
8	601328	交通银行	1,177,700	7,584,388.00	1.80
9	600900	长江电力	541,102	7,337,343.12	1.74
10	601169	北京银行	677,720	7,136,391.60	1.69
11	600030	中信证券	347,000	6,714,450.00	1.59
12	600519	贵州茅台	26,500	5,782,035.00	1.37
13	601818	光大银行	1,267,600	5,374,624.00	1.28
14	601398	工商银行	1,170,000	5,358,600.00	1.27
15	601888	中国国旅	87,000	5,159,970.00	1.23
16	601668	中国建筑	813,200	5,155,688.00	1.22
17	000800	一汽轿车	277,773	4,547,144.01	1.08
18	600690	青岛海尔	457,138	4,534,808.96	1.08
19	600015	华夏银行	368,504	4,473,638.56	1.06
20	601988	中国银行	1,077,700	4,321,577.00	1.03
21	000001	平安银行	357,000	4,280,430.00	1.02
22	600649	城投控股	178,000	4,122,480.00	0.98
23	601088	中国神华	257,000	3,847,290.00	0.91
24	601006	大秦铁路	432,200	3,725,564.00	0.88
25	600741	华域汽车	215,000	3,624,900.00	0.86
26	000002	万科A	139,000	3,395,770.00	0.81

27	600048	保利地产	317,700	3,380,328.00	0.80
28	600104	上汽集团	157,700	3,346,394.00	0.79
29	601009	南京银行	177,000	3,132,900.00	0.74
30	601688	华泰证券	152,700	3,011,244.00	0.72
31	000983	西山煤电	477,218	2,901,485.44	0.69
32	000858	五粮液	106,300	2,899,864.00	0.69
33	601939	建设银行	499,700	2,888,266.00	0.69
34	600637	东方明珠	75,801	2,872,099.89	0.68
35	000776	广发证券	147,100	2,861,095.00	0.68
36	600177	雅戈尔	170,000	2,767,600.00	0.66
37	600276	恒瑞医药	55,903	2,745,955.36	0.65
38	000063	中兴通讯	146,041	2,720,743.83	0.65
39	600028	中国石化	529,885	2,628,229.60	0.62
40	600739	辽宁成大	115,025	2,599,565.00	0.62
41	002024	苏宁云商	191,000	2,568,950.00	0.61
42	601699	潞安环能	377,000	2,420,340.00	0.57
43	600585	海螺水泥	138,728	2,372,248.80	0.56
44	600153	建发股份	170,000	2,364,700.00	0.56
45	601607	上海医药	115,200	2,293,632.00	0.54
46	000917	电广传媒	85,953	2,282,911.68	0.54
47	000625	长安汽车	132,100	2,241,737.00	0.53
48	601628	中国人寿	77,000	2,179,870.00	0.52
49	601186	中国铁建	157,000	2,116,360.00	0.50
50	600795	国电电力	503,800	1,979,934.00	0.47
51	601336	新华保险	37,700	1,968,317.00	0.47
52	600009	上海机场	66,510	1,963,375.20	0.47
53	601857	中国石油	227,900	1,902,965.00	0.45
54	600089	特变电工	159,809	1,880,951.93	0.45
55	601618	中国中冶	300,000	1,806,000.00	0.43
56	600718	东软集团	57,900	1,797,795.00	0.43
57	600050	中国联通	289,000	1,786,020.00	0.42
58	000333	美的集团	53,264	1,748,124.48	0.42
59	000100	TCL 集团	407,200	1,734,672.00	0.41
60	600674	川投能源	160,000	1,721,600.00	0.41
61	002008	大族激光	66,000	1,708,740.00	0.41
62	600019	宝钢股份	306,100	1,708,038.00	0.41
63	000793	华闻传媒	112,493	1,690,769.79	0.40
64	600100	同方股份	92,400	1,670,592.00	0.40

65	000423	东阿阿胶	31,531	1,649,071.30	0.39
66	000069	华侨城 A	186,400	1,640,320.00	0.39
67	600011	华能国际	187,700	1,638,621.00	0.39
68	000651	格力电器	71,218	1,591,722.30	0.38
69	002142	宁波银行	100,000	1,551,000.00	0.37
70	000963	华东医药	18,896	1,548,716.16	0.37
71	600309	万华化学	85,658	1,528,995.30	0.36
72	601899	紫金矿业	422,933	1,488,724.16	0.35
73	601998	中信银行	203,700	1,470,714.00	0.35
74	601669	中国电建	179,200	1,438,976.00	0.34
75	000157	中联重科	266,486	1,425,700.10	0.34
76	600886	国投电力	170,000	1,419,500.00	0.34
77	000937	冀中能源	277,000	1,396,080.00	0.33
78	600588	用友网络	43,800	1,393,278.00	0.33
79	600383	金地集团	100,000	1,380,000.00	0.33
80	002594	比亚迪	21,000	1,352,400.00	0.32
81	000402	金融街	117,000	1,349,010.00	0.32
82	600352	浙江龙盛	115,604	1,345,630.56	0.32
83	600118	中国卫星	30,503	1,297,597.62	0.31
84	000768	中航飞机	52,159	1,291,978.43	0.31
85	600827	百联股份	71,183	1,272,040.21	0.30
86	000999	华润三九	46,300	1,263,990.00	0.30
87	000728	国元证券	55,770	1,259,844.30	0.30
88	000623	吉林敖东	40,700	1,259,665.00	0.30
89	600893	中航动力	27,655	1,245,304.65	0.30
90	600029	南方航空	142,562	1,221,756.34	0.29
91	600150	中国船舶	35,000	1,219,050.00	0.29
92	000338	潍柴动力	117,400	1,134,084.00	0.27
93	600221	海南航空	289,700	1,126,933.00	0.27
94	600068	葛洲坝	143,005	1,125,449.35	0.27
95	000568	泸州老窖	40,800	1,106,496.00	0.26
96	601098	中南传媒	46,193	1,104,012.70	0.26
97	601390	中国中铁	100,000	1,092,000.00	0.26
98	000581	威孚高科	43,842	1,085,527.92	0.26
99	000061	农产品	60,000	1,061,400.00	0.25
100	600369	西南证券	107,124	1,060,527.60	0.25
101	601992	金隅股份	111,400	1,043,818.00	0.25
102	000686	东北证券	59,600	1,043,000.00	0.25

103	600170	上海建工	144,428	1,022,550.24	0.24
104	000629	攀钢钒钛	277,910	1,019,929.70	0.24
105	600660	福耀玻璃	65,900	1,001,021.00	0.24
106	000876	新希望	51,313	974,433.87	0.23
107	600315	上海家化	24,000	947,760.00	0.23
108	601800	中国交建	70,000	938,700.00	0.22
109	600583	海油工程	102,300	915,585.00	0.22
110	600873	梅花生物	100,000	914,000.00	0.22
111	600839	四川长虹	157,500	911,925.00	0.22
112	600332	白云山	30,000	908,100.00	0.22
113	601333	广深铁路	178,800	895,788.00	0.21
114	600018	上港集团	137,000	887,760.00	0.21
115	601933	永辉超市	87,381	882,548.10	0.21
116	000712	锦龙股份	30,000	873,600.00	0.21
117	601018	宁波港	106,318	867,554.88	0.21
118	600642	申能股份	112,500	849,375.00	0.20
119	002007	华兰生物	19,200	844,800.00	0.20
120	600600	青岛啤酒	24,375	809,250.00	0.19
121	601117	中国化学	116,745	804,373.05	0.19
122	600837	海通证券	50,000	791,000.00	0.19
123	000400	许继电气	40,034	777,860.62	0.18
124	600688	上海石化	119,909	777,010.32	0.18
125	000039	中集集团	37,000	777,000.00	0.18
126	000792	盐湖股份	30,000	770,400.00	0.18
127	601928	凤凰传媒	47,707	759,972.51	0.18
128	600362	江西铜业	47,522	747,996.28	0.18
129	002081	金螳螂	40,000	747,200.00	0.18
130	600547	山东黄金	35,108	737,268.00	0.18
131	600000	浦发银行	40,000	730,800.00	0.17
132	000538	云南白药	10,000	726,200.00	0.17
133	300251	光线传媒	22,900	693,641.00	0.16
134	000027	深圳能源	70,502	691,624.62	0.16
135	000729	燕京啤酒	83,400	686,382.00	0.16
136	600166	福田汽车	105,913	670,429.29	0.16
137	600863	内蒙华电	149,200	666,924.00	0.16
138	600060	海信电器	33,801	664,865.67	0.16
139	600038	中直股份	12,568	662,710.64	0.16
140	000778	新兴铸管	100,000	649,000.00	0.15

141	600208	新湖中宝	135,882	648,157.14	0.15
142	601158	重庆水务	68,728	641,232.24	0.15
143	601258	庞大集团	162,554	637,211.68	0.15
144	000750	国海证券	49,373	634,443.05	0.15
145	000630	铜陵有色	170,000	608,600.00	0.14
146	601898	中煤能源	100,000	605,000.00	0.14
147	002294	信立泰	20,000	602,400.00	0.14
148	600578	京能电力	97,142	589,651.94	0.14
149	600717	天津港	50,828	572,831.56	0.14
150	000709	河北钢铁	170,000	566,100.00	0.13
151	002375	亚厦股份	34,959	551,303.43	0.13
152	002236	大华股份	14,900	549,810.00	0.13
153	600008	首创股份	52,783	537,858.77	0.13
154	000898	鞍钢股份	111,887	533,700.99	0.13
155	600023	浙能电力	70,011	524,382.39	0.12
156	601225	陕西煤业	105,299	511,753.14	0.12
157	600031	三一重工	62,850	413,553.00	0.10
158	000598	兴蓉环境	57,711	410,902.32	0.10
159	600256	广汇能源	59,714	398,292.38	0.09
160	600875	东方电气	28,516	388,673.08	0.09
161	000825	太钢不锈	90,405	370,660.50	0.09
162	600648	外高桥	13,700	359,899.00	0.09
163	603000	人民网	15,710	358,345.10	0.09
164	000725	京东方 A	117,170	347,994.90	0.08
165	601118	海南橡胶	40,840	308,750.40	0.07
166	000883	湖北能源	50,000	307,000.00	0.07
167	000539	粤电力 A	40,000	294,000.00	0.07
168	600157	永泰能源	61,023	291,079.71	0.07
169	600804	鹏博士	11,841	280,868.52	0.07
170	601231	环旭电子	18,000	260,280.00	0.06
171	002410	广联达	11,600	210,888.00	0.05
172	600188	兖州煤业	20,000	189,000.00	0.04
173	601808	中海油服	10,000	155,200.00	0.04
174	300133	华策影视	4,500	134,055.00	0.03
175	002202	金风科技	5,000	113,950.00	0.03
176	002065	东华软件	1,823	45,757.30	0.01

## 8.3.2 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	297,000	5,108,400.00	1.21
2	300406	九强生物	50,000	2,344,000.00	0.56
3	000839	中信国安	80,758	1,643,425.30	0.39
4	600123	兰花科创	177,000	1,421,310.00	0.34
5	600597	光明乳业	77,000	1,225,840.00	0.29
6	600835	上海机电	30,000	909,300.00	0.22
7	601168	西部矿业	100,000	739,000.00	0.18
8	600062	华润双鹤	27,000	615,870.00	0.15
9	600516	方大炭素	47,700	596,727.00	0.14
10	600316	洪都航空	20,794	485,331.96	0.12
11	000878	云南铜业	33,300	461,205.00	0.11
12	002001	新和成	25,214	439,732.16	0.10
13	600348	阳泉煤业	60,000	387,600.00	0.09
14	601929	吉视传媒	57,728	356,759.04	0.08
15	600395	盘江股份	41,100	337,431.00	0.08
16	600829	人民同泰	17,000	282,370.00	0.07
17	600809	山西汾酒	14,280	275,175.60	0.07
18	002781	奇信股份	500	18,685.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 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	83,745,529.76	4.46
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	601988	中国银行	28,785,230.94	1.53
5	601231	环旭电子	25,823,000.00	1.38
6	601601	中国太保	24,483,128.47	1.30
7	600036	招商银行	19,263,082.78	1.03

8	600795	国电电力	18,203,539.79	0.97
9	600000	浦发银行	17,315,095.84	0.92
10	601398	工商银行	13,768,740.00	0.73
11	002594	比亚迪	13,612,000.00	0.73
12	001979	招商蛇口	12,574,477.78	0.67
13	000002	万科A	10,705,807.00	0.57
14	601328	交通银行	10,112,133.83	0.54
15	601166	兴业银行	8,896,904.00	0.47
16	000895	双汇发展	8,808,626.28	0.47
17	601006	大秦铁路	7,944,137.00	0.42
18	601939	建设银行	7,357,773.00	0.39
19	600030	中信证券	7,195,027.00	0.38
20	000750	国海证券	6,321,797.00	0.34

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。

#### 8.4.2 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	144,454,627.13	7.69
2	600016	民生银行	122,136,875.89	6.51
3	600036	招商银行	77,617,876.96	4.13
4	600000	浦发银行	70,700,206.62	3.77
5	601601	中国太保	54,462,541.27	2.90
6	601166	兴业银行	53,776,164.11	2.86
7	000002	万科A	43,831,473.39	2.33
8	600028	中国石化	42,219,294.53	2.25
9	601328	交通银行	41,351,852.87	2.20
10	600030	中信证券	41,107,430.66	2.19
11	000895	双汇发展	40,245,732.58	2.14
12	600153	建发股份	39,832,103.90	2.12
13	601988	中国银行	34,777,271.18	1.85
14	600837	海通证券	32,147,851.69	1.71
15	600795	国电电力	31,380,468.83	1.67
16	600741	华域汽车	31,189,474.81	1.66
17	600104	上汽集团	29,598,000.22	1.58

18	601088	中国神华	29,195,320.52	1.56
19	601390	中国中铁	27,873,444.91	1.48
20	601231	环旭电子	26,703,906.71	1.42

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。

### 8.4.3 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	583,696,477.32
卖出股票收入（成交）总额	2,162,503,846.63

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。

### 8.5 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	20,062,000.00	4.76
	其中：政策性金融债	20,062,000.00	4.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	23,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,085,000.00	4.77

### 8.6 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	150307	15 进出 07	100,000	10,033,000.00	2.38
2	150411	15 农发 11	100,000	10,029,000.00	2.38
3	123001	蓝标转债	230	23,000.00	0.01

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 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	344,052.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	504,923.13
5	应收申购款	1,083,712.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,932,688.06

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 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。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
13,246	22,951.73	39,102,195.37	12.86%	264,916,397.96	87.14%

## 9.2 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	吴建城	662,381.00	10.67%
2	陈翠芳	662,381.00	10.67%
3	吴家驹	662,381.00	10.67%
4	周素菊	416,623.00	6.71%
5	王乐京	201,342.00	3.24%
6	冯学正	124,826.00	2.01%
7	陈敏丽	105,400.00	1.70%
8	陆伟昌	97,700.00	1.57%
9	周小刚	81,800.00	1.32%
10	王菊萍	76,817.00	1.24%

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

## 9.3 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	806,300.25	0.2652%

## 9.4 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、基金投资和研发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

## § 10 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	780,662,512.23
减:本报告期基金总赎回份额	1,960,778,109.07
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-

本报告期末基金份额总额	304,018,593.33
-------------	----------------

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为进一步维护基金持有人利益，合理控制基金运作成本，同时促进会计师事务所持续提供更优质的服务，根据基金管理人内部制度要求及适当评估程序，本基金的审计机构由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）更改为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费为 4.8 万元。本次会计师事务所的变更已经基金管理人董事会审批，并履行了必要的程序。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门

的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	2,376,842,202.15	91.37%	1,690,880.40	91.30%	-
民族证券	1	224,627,787.06	8.63%	161,054.37	8.70%	-

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。

### 11.7.2 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	127,069,445.60	96.79%	885,500,000.00	78.51%	-	-
民族证券	4,212,530.10	3.21%	242,400,000.00	21.49%	-	-

## 11.8 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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	2015 年 4 月 3 日
17	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 4 月 4 日
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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	2015 年 4 月 25 日
27	关于兴业银行电子渠道代销系统	中国证券报、上海证券报、	2015 年 4 月 25 日

	基金申购费率优惠比例调整的提示性公告	证券时报、管理人网站	
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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	2015 年 5 月 26 日
39	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、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 5 月 27 日
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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	2015 年 6 月 5 日
48	关于长期停牌股票 (城投控股) 估	中国证券报、上海证券报、	2015 年 6 月 9 日

	值方法调整的公告	证券时报、管理人网站	
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、管理人网站	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、管理人网站	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、管理人网站	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率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	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、管理人网站	2015 年 6 月 30 日
54	旗下各基金 2015 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 1 日
55	关于长期停牌股票（皇氏集团）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 2 日
56	关于长期停牌股票（骆驼股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 7 日
57	关于公司自有资金及公司高级管理人员投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 7 日
58	关于长期停牌股票（宁波韵升、建发股份、华录百纳、长江电力）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 8 日
59	关于长期停牌股票（鼎龙股份、海澜之家、三泰控股、尚荣医疗、东富龙、中茵股份、通化东宝）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 9 日
60	关于长期停牌股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 9 日
61	关于长期停牌股票（浪莎股份、黄河旋风、联络互联、中央商场、康尼机电、恒立油缸、万丰奥威、欧菲光）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 10 日
62	关于长期停牌股票估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 11 日
63	关于长期停牌股票（南方泵业、丽珠集团、紫鑫药业、北京文化、网宿科技、康得新、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、管理人网站	2015 年 7 月 14 日
64	关于长期停牌股票（富安娜、游族网络、骅威股份、神州信息、神州	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 15 日

	泰岳) 估值方法调整的公告		
65	关于长期停牌股票 (荣科科技) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 16 日
66	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、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 22 日
67	关于长期停牌股票 (利君股份) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 23 日
68	关于增加同花顺基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 24 日
69	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售申购或定期定额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、管理人网站	2015 年 7 月 24 日
70	关于旗下部分基金参加浦发银行网上银行、手机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、管理人网站	2015 年 7 月 29 日
71	关于长期停牌股票 (电广传媒) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 7 月 29 日
72	关于长期停牌股票 (游族网络) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 4 日
73	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售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、管理人网站	2015 年 8 月 5 日
74	关于旗下部分基金参与数米基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 12 日
75	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售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、管理人网站	2015 年 8 月 12 日
76	关于养老金账户通过直销柜台申购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、管理人网站	2015 年 8 月 15 日
77	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售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、管理人网站	2015 年 8 月 19 日
78	关于长期停牌股票 (中央商场) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 22 日
79	关于长期停牌股票 (骅威股份、丽珠集团) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 24 日
80	关于长期停牌股票 (长电科技、五粮液) 估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 26 日
81	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售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、管理人网站	2015 年 8 月 26 日
82	关于参加天天基金网费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 27 日
83	关于调整天天基金网申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 27 日
84	关于参加天天基金网费率优惠活	中国证券报、上海证券报、	2015 年 8 月 27 日

	动的公告	证券时报、管理人网站	
85	关于长期停牌股票（北新建材、恒立油缸）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 28 日
86	关于调整旗下开放式基金在数米基金销售平台申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 28 日
87	关于通过国都证券基金“手机炒股”申购旗下部分基金实施优惠费率活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 8 月 31 日
88	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 2 日
89	关于旗下部分基金参加同花顺基金销售费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 9 日
90	关于长期停牌股票（ST 海润）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 18 日
91	关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 18 日
92	关于调整网上直销部分基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 24 日
93	关于暂缓开展网上直销部分基金转换 0 费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 25 日
94	关于增加江南农商行为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 9 月 25 日
95	关于长期停牌股票（雅本化学）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 10 月 10 日
96	关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 10 月 22 日
97	关于旗下部分基金更换会计师事务所的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 10 月 24 日
98	关于长期停牌股票（北京银行）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 10 日
99	关于长期停牌股票（立讯精密）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 24 日
100	关于长期停牌股票（飞乐音响）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 26 日
101	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 27 日
102	关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2015 年 11 月 30 日
103	关于旗下部分基金参与上海陆金	中国证券报、上海证券报、	2015 年 11 月 30 日

	所资产管理有限公司费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	
104	关于参加国信证券网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 4 日
105	关于长期停牌股票（海兰信）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 4 日
106	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、管理人网站	2015 年 12 月 7 日
107	关于长期停牌股票（福瑞股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 9 日
108	关于开通网上直销汇款交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 17 日
109	关于开展网上交易汇款交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 17 日
110	关于长期停牌股票（鲁银投资）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 19 日
111	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、管理人网站	2015 年 12 月 22 日
112	关于调整旗下基金在国信证券定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 30 日
113	关于旗下部分基金参加邮储银行网银、手机银行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 31 日
114	关于旗下部分基金参加农业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、管理人网站	2015 年 12 月 31 日
115	关于旗下部分基金参加平安银行网上银行申购、定期定额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、管理人网站	2015 年 12 月 31 日
116	关于旗下部分基金参加中国工商银行定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 31 日
117	关于在指数熔断实施期间调整旗下基金开放时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2015 年 12 月 31 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 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

2016 年 3 月 25 日