兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

2014 年度 报告摘要

2014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:2015年3月27日

§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2015年3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。

本报告期自2014年01月01日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全沪深300指数(LOF)
场内简称	兴全300
基金主代码	163407
前端交易代码	163407
后端交易代码	163408
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年11月2日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,484,134,190.17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

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyfunds.com.cn
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

§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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	20,010,684.16	-83,016,767.38	-134,636,417.71
本期利润	620,935,743.11	-69,261,715.62	139,443,171.78
加权平均基金份额本期利润	0.4753	-0.0448	0.0791
本期基金份额净值增长率	57.16%	-4.64%	9.40%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1299	-0.1951	-0.1559
期末基金资产净值	1,877,410,948.12	1,121,622,580.85	1,271,003,279.81
期末基金份额净值	1.2650	0.8049	0.8441

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	45.39%	1.62%	41.64%	1.56%	3.75%	0.06%
过去六个月	65.36%	1.32%	59.38%	1.26%	5.98%	0.06%
过去一年	57.16%	1.20%	48.72%	1.15%	8.44%	0.05%
过去三年	63.95%	1.25%	48.18%	1.23%	15.77%	0.02%
自基金合同生效起至今	26.50%	1.20%	2.24%	1.25%	24.26%	-0.05%

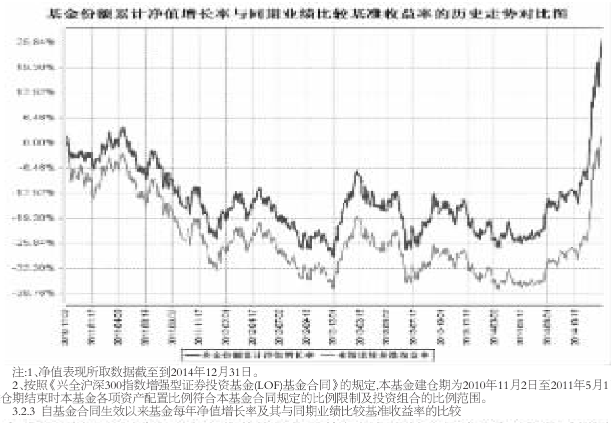
注:本基金为指数增强型证券投资基金,标的指数是沪深300指数,本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =95%×(沪深300指数t / 沪深300指数t-1 -1)+5%×(同业存款利率t/360)

Benchmark t =(1+Return t)×(1+Benchmark t-1)-1

其中,t =1,2,3,…T,T表示时间截至日。

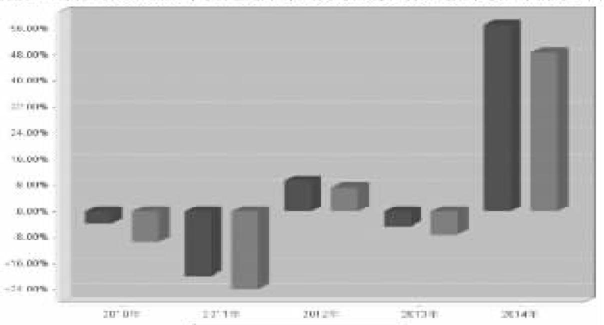
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、净值表现所取数据截至到2014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 自基金合同生效以来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



注:2010年数据统计期间为2010年11月2日(基金合同生效之日)至2010年12月31日,数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 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2014年12月31日,公司旗下管理着十四只基金,分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申庆	本基金基金经理	2010年11月2日	–	17年	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

2014年A股市场波澜起伏。上半年A股市场风格延续2013年小强大弱的格局,创业板、中小板等小市值公司表现良好,沪深300、中证100、上证50下跌明显。

下半年伊始在沪港通预期的刺激下,A股市场整体性上涨, 大小盘风格轮番转换。11月17日沪港通的实施和11月21日央行的非对称降息是2014年A股的转折点。沪深300、中证100、上证50等反映市场整体状况的综合性指数实现逆袭,显著超越了中证500、中小板和创业板等中小市值板块。

本基金坚持低估值、高分红、大市值的价值型投资策略较好地切合了市场风格。同时基金小组不断优化成分股的行业与个股配置策略, 积极参与了成分股及其衍生品的套利活动来提升增强效果。2014年基金净值增长较好地弥补了上一年度显著落后主动型股票基金产品的不利形势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金实现了较好的超额收益,本基金份额净值增长率57.16%,同期业绩比较基准收益率48.72%。但留下的缺憾和不足依然很多,希望在日后得到改善,并使基金超额收益得以保持和提升。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济新常态下的A股市场在2014年出人意料地实现大反转。存量博弈游戏所导致的小市值公司结构性估值泡沫、大市值股票长期估值过低的市场格局突然被无形的市场力量所终结。与此同时A股投资者的信心进一步恢复,市场交易量和融资融券额不断创出新高。虽然很多人对市场的突然变化无法理解,但我们认为这是全面改革稳步推进背景下,对宏观经济质量改善以及制度性红利逐步体现的较好预期在A股市场的合理反映。

由于短期市场累计涨幅较大,市场需要休整和巩固。不少投资者过度利用杠杆进行投资也是不可忽视的潜在风险。好在管理层已经充分察觉到其中的隐患并采取了稳妥有效的措施。我们确信中国的经济结构转型会成功,更高质量的增长会实现,改革的红利会持续兑现,相信在化解了过度融资杠杆投资风险后的A股牛市将更为扎实。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管兴全沪深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2014年1月1日至2014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,除2014年7月23日至2014年8月5日,兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)连续10个交易日股票投资占基金资产净值的比例超过95%,违反了基金合同中“投资股票的比例不得超过基金资产净值的95%”的约定,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

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	安永华明(2015)审字第60467611_B09号
备注	投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文

§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: 2014年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产:			
银行存款		14,205,988.51	22,528,726.99
结算备付金		1,233,099.70	343,845.26
存出保证金		186,229.01	288,617.48
交易性金融资产		1,855,294,704.11	1,081,200,388.49
其中:股票投资		1,774,191,346.50	1,026,841,115.49
基金投资		–	–
债券投资		81,103,357.61	54,359,273.00
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		9,000,000.00	–
应收证券清算款		13,052,950.90	38,715,331.93
应收利息		1,685,061.79	1,029,133.60
应收股利		–	–
应收申购款		13,425,684.90	120,898.34
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,908,083,718.92	1,144,226,942.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负 债:			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债		–	–
卖出回购金融资产款		–	19,799,870.10
应付证券清算款		3,096,056.81	–
应付赎回款		25,495,060.71	1,167,179.20
应付管理人报酬		1,105,262.48	793,985.51
应付托管费		207,236.74	148,872.29
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		575,672.31	237,724.82
应交税费		–	–
应付利息		–	1,779.14
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		193,481.75	454,950.18
负债合计		30,672,770.80	22,604,361.24
所有者权益:			
实收基金		1,484,134,190.17	1,393,516,681.59
未分配利润		393,276,757.95	-271,894,100.74
所有者权益合计		1,877,410,948.12	1,121,622,580.85
负债和所有者权益总计		1,908,083,718.92	1,144,226,942.09

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.2650元,基金份额总额1,484,134,190.17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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		634,306,773.33	-54,163,440.31
1.利息收入		2,401,235.39	1,841,654.24
其中:存款利息收入		137,569.24	131,500.62
债券利息收入		1,987,224.85	1,589,378.19
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		276,441.30	120,775.43
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		30,465,502.44	-70,307,024.16
其中:股票投资收益		-5,206,194.06	-101,751,328.93
基金投资收益		–	–
债券投资收益		6,469,079.63	869,567.13
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		29,202,616.87	30,574,737.64
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		600,925,058.95	13,755,051.76
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)		514,976.55	546,877.85
减:二、费用		13,371,030.22	15,098,275.31
1.管理人报酬		8,734,609.65	10,289,210.19
2.托管费		1,637,739.28	1,929,226.88
3.销售服务费		–	–
4.交易费用		1,857,055.73	1,743,365.89
5.利息支出		447,912.39	446,643.91
其中:卖出回购金融资产支出		447,912.39	446,643.91
6.其他费用		693,713.17	689,828.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		620,935,743.11	-69,261,715.62
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		620,935,743.11	-69,261,715.62

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:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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
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(本期净利润)	–	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
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	1,505,704,912.09	-234,701,632.28	1,271,003,279.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	-69,261,715.62	-69,261,715.62
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)	-112,188,230.50	32,069,247.16	-80,118,983.34
其中:1.基金申购款	707,467,531.64	-110,969,078.06	596,498,453.58
2.基金赎回款	-819,655,762.14	143,038,325.22	-676,617,436.92
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)	1,393,516,681.59	-271,894,100.74	1,121,622,580.85

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:

______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

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

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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。

采用若干修订后/新会计准则

2014年1至3月,财政部制定了《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》和《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》; 修订了 《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》和《企业会计准则第33号——合并财务报表》;上述7项会计准则均自2014年7月1日起施行。2014年6月,财政部修订了《企业会计准则第37号——金融工具列报》,在2014年年度及以后期间的财务报告中施行。

上述会计准则的变化对本基金的财务报表无重大影响。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

本基金本报告期会计政策变更的说明在7.4.2会计报表的编制基础中披露。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 营业税、企业所得税

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

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

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

7.4.6.3 个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	948,840,865.03	69.61%	990,959,688.76	80.06%

7.4.8.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	215,786,119.90	85.68%	75,250,172.80	74.74%

7.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	1,082,600,000.00	75.36%	412,900,000.00	69.27%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年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%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	702,674.28	80.03%	178,196.01	75.60%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,734,609.65	10,289,210.19
其中:支付销售机构的客户维护费	2,404,095.20	2,984,638.18

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,637,739.28	1,929,226.88

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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	14,205,988.51	113,389.60	22,528,726.99	116,555.03

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.10.1.1 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
000100	TCL集团	2014年4月29日	2015年4月30日	非公开发行流通受限	2.18	3.29	1,700,000	3,706,000.00	5,593,000.00	–
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	76.95	39,398	564,179.36	3,031,676.10	–

7.4.10.1.2 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
110030	格力转债	2014年12月30日	2015年1月13日	新债未上市	100.00	100.00	10,960	1,096,000.00	1,096,000.00	–

7.4.9.2 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
600664	哈药股份	2014年12月31日	筹划重大事项	8.68	2015年2月17日	9.45	1,970,000	21,645,103.17	17,099,600.00	–
600649	城投控股	2014年11月3日	重大资产重组	7.23	–	–	278,939	1,739,655.45	2,016,728.97	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2014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资产中属于第一层次的余额为人民币1,749,482,375.14元,属于第二层次的余额为人民币105,812,328.97元,属于第三层次余额为人民币0.00元(于2013年12月31日,第一层次的余额为人民币1,022,446,758.27元,属于第二层次的余额为人民币58,753,630.22元,属于第三层次余额为人民币0.00元)。

7.4.14.1.2.2 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不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并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。

7.4.14.1.2. 3 第三层次公允价值本期变动金额

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第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	1,774,191,346.50	92.98
	其中:股票	1,774,191,346.50	92.98
2	固定收益投资	81,103,357.61	4.25
	其中:债券	81,103,357.61	4.25
	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	9,000,000.00	0.47
	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	15,439,088.21	0.81
7	其他各项资产	28,349,926.60	1.49
8	合计	1,908,083,718.92	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	543,212.40	0.03
B	采矿业	119,122,651.73	6.35
C	制造业	422,252,646.05	22.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,599,585.01	2.64
E	建筑业	97,322,720.07	5.18
F	批发和零售业	61,928,453.35	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	38,922,678.40	2.07
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,667,750.33	1.63
J	金融业	751,033,378.42	40.00
K	房地产业	91,139,176.71	4.85
L	租赁和商务服务业	12,279,986.99	0.65
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	11,413,439.00	0.61
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	4,490,508.68	0.24
S	综合	–	–
	合计	1,690,716,187.14	90.06

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	13,029,241.81	0.69
C	制造业	50,189,655.74	2.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,685,317.81	0.20
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	854,469.00	0.05
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	71,120.00	0.00
K	房地产业	13,677,991.00	0.73
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	1,967,364.00	0.10
	合计	83,475,159.36	4.45

8.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,879,755	140,436,496.05	7.48
2	600036	招商银行	4,431,200	73,513,608.00	3.92
3	601166	兴业银行	3,331,600	54,971,400.00	2.93
4	600016	民生银行	5,033,200	54,761,216.00	2.92
5	600000	浦发银行	3,438,500	53,950,065.00	2.87
6	600030	中信证券	1,507,000	51,087,300.00	2.72
7	601328	交通银行	5,832,300	39,659,640.00	2.11
8	601601	中国太保	1,217,100	39,312,330.00	2.09
9	000895	双汇发展	1,177,773	37,158,738.15	1.98
10	600837	海通证券	1,520,000	36,571,200.00	1.95

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站http://www.xyfunds.com.cn的年度报告正文。

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	1,277,075	17,368,220.00	0.93
2	000933	神火股份	2,177,000	13,040,230.00	0.69
3	600123	兰花科创	777,700	8,010,310.00	0.43
4	000732	泰禾集团	437,700	7,200,165.00	0.38
5	600062	华润双鹤	333,300	6,752,658.00	0.36

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站http://www.xyfunds.com.cn的年度报告正文。

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	600795	国电电力	140,780,854.69	12.55
2	601318	中国平安	104,028,828.21	9.27
3	600153	建发股份	33,832,159.86	3.02
4	601989	中国重工	28,773,994.38	2.57
5	601988	中国银行	25,543,266.81	2.28
6	600016	民生银行	21,738,308.39	1.94
7	000895	双汇发展	17,892,036.31	1.60
8	601699	潞安环能	17,140,297.68	1.53
9	600036	招商银行	15,236,847.15	1.36
10	300224	正海磁材	14,535,000.00	1.30
11	601398	工商银行	14,112,566.00	1.26
12	600837	海通证券	13,912,207.75	1.24
13	601328	交通银行	13,665,620.52	1.22
14	000100	TCL集团	12,726,881.00	1.13
15	601601	中国太保	11,241,683.86	1.00
16	600000	浦发银行	10,731,738.00	0.96
17	600028	中国石化	10,413,675.70	0.93
18	600741	华域汽车	10,149,716.08	0.90
19	600104	上汽集团	9,695,400.38	0.86
20	000002	万科A	9,468,556.00	0.84

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	600795	国电电力	126,795,194.75	11.30
2	601318	中国平安	77,251,483.22	6.89
3	000732	泰禾集团	37,770,939.25	3.37
4	600109	国金证券	29,579,311.59	2.64
5	601988	中国银行	25,082,284.01	2.24
6	601989	中国重工	24,683,443.93	2.20
7	600016	民生银行	20,091,487.81	1.79
8	601328	交通银行	16,405,582.91	1.46
9	600000	浦发银行	14,055,786.39	1.25
10	600036	招商银行	12,164,627.64	1.08
11	300224	正海磁材	12,087,019.86	1.08
12	600664	哈药股份	11,665,229.45	1.04
13	600028	中国石化	10,736,251.41	0.96
14	000919	金陵药业	9,859,554.00	0.88
15	600741	华域汽车	9,536,025.24	0.85
16	000895	双汇发展	8,931,428.60	0.80
17	000933	神火股份	8,478,876.45	0.76
18	600383	金地集团	8,441,529.33	0.75
19	600546	山煤国际	7,615,753.93	0.68
20	601166	兴业银行	7,353,880.29	0.66

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	881,400,252.60
卖出股票收入(成交)总额	711,952,974.59

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	80,007,000.00	4.26
	其中:政策性金融债	80,007,000.00	4.26
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	1,096,357.61	0.06
8	其他	–	–
9	合计	81,103,357.61	4.32

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	140223	14国开23	200,000	20,026,000.00	1.07
1	140320	14进出20	200,000	20,026,000.00	1.07
2	120229	12国开29	200,000	19,926,000.00	1.06
3	140444	14农发44	100,000	10,022,000.00	0.53
4	140218	14国开18	100,000	10,007,000.00	0.53
5	110030	格力转债	10,960	1,096,000.00	0.06

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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	186,229.01
2	应收证券清算款	13,052,950.90
3	应收股利	–
4	应收利息	1,685,061.79
5	应收申购款	13,425,684.90
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	28,349,926.60

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127002	徐工转债	357.61	0.00

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
24,477	60,633.83	723,800,979.23	48.77%	760,333,210.94	51.23%

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	周雷	600,030.00	4.86%
2	许飞	596,030.00	4.83%
3	毛天翼	432,888.00	3.51%
4	王芳	400,020.00	3.24%
5	李荣	307,900.00	2.50%
6	王乐京	300,042.00	2.43%
7	黄海	217,751.00	1.77%
8	刘爽	200,052.00	1.62%
9	陈美娥	200,009.00	1.62%
10	郑大安	192,300.00	1.56%

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	1,149,466.07	0.0775%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§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	1,393,516,681.59
本报告期基金总申购份额	1,211,034,085.36
减:本报告期基金总赎回份额	1,120,416,576.78
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	1,484,134,190.17

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:

2014年2月27日公告,公司副总经理王晓明于2014年2月26日起离任;

2014年3月20日公告,公司独立董事欧阳辉先生任职,独立董事吴雅伦先生离任;

2014年9月24日公告,公司董事巴斯蒂安.范布伦先生(Bastiaan Van Buuren)任职,董事霍以礼先生(Elio Fattorini)离任;

2014年11月21日公告,公司选举产生第四届董事会,由以下九名董事组成:兰荣先生,张训苏先生,杨东先生,万维德先生(Marc van Weede),巴斯蒂安.范布伦先生(Bastiaan Van Buuren),桑德.马特曼先生(Sander Maatman),欧阳辉先生(独立董事),吴明先生(独立董事),周鹤松先生(独立董事)。

(2)报告期内本基金托管人重大人事变动。

因中国农业银行股份有限公司(以下简称“本行”)工作需要,任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

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

本基金自基金合同生效日起连续5年聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所10万元人民币。

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	948,840,865.03	69.61%	675,064.10	69.64%	–
民族证券	1	414,311,529.65	30.39%	294,326.05	30.36%	–

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	215,786,119.90	85.68%	1,082,600,000.00	75.36%	–	–
民族证券	36,062,714.80	14.32%	354,000,000.00	24.64%	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司
2015年3月27日