

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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

报告送出日期：2016 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
交易代码	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
报告期末基金份额总额	295,259,044.97 份
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2016 年 7 月 1 日 — 2016 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	7,958,833.11
2. 本期利润	22,503,360.11
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0754
4. 期末基金资产净值	391,638,063.34
5. 期末基金份额净值	1.3264

注：1、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。

2、所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：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。

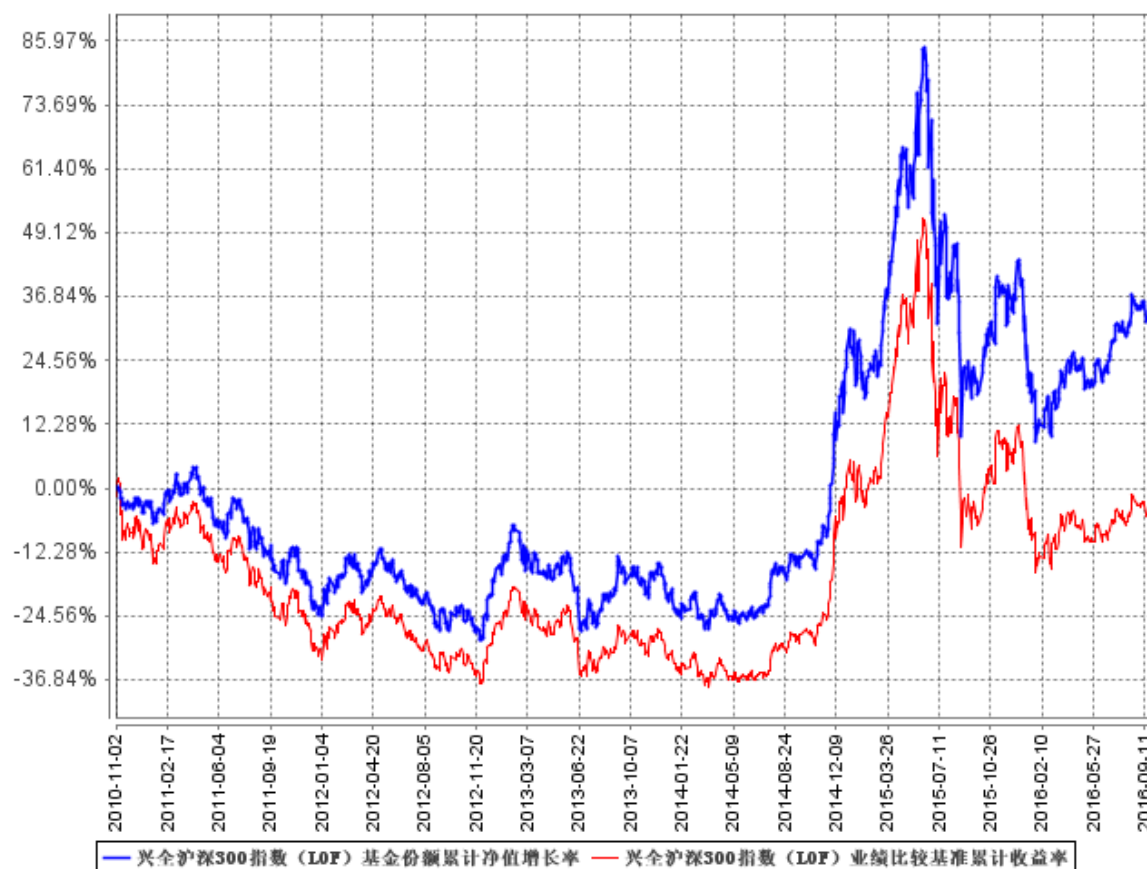
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	5.91%	0.74%	3.01%	0.76%	2.90%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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 2016 年 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2010 年 11 月 2 日	-	19 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

	型证券投资 基金基金 经理				基金（LOF）基金经理助理、 基金管理部总监助理。
--	---------------------	--	--	--	------------------------------

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

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

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金始终坚持价值投资的风格，重点配置大盘蓝筹板块。本基金尽量避免频繁交易，除非应对申购、赎回，以及必要的套利机会。三季度行业配置和持股结构保持稳定。报告期内基金小组一如既往地参与各种低风险或无风险套利活动，以期持续累计超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 5.91%，同期业绩比较基准收益率为 3.01%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	371,234,776.94	94.33
	其中：股票	371,234,776.94	94.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,152,848.00	5.12
	其中：债券	20,152,848.00	5.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	956,508.42	0.24
8	其他资产	1,220,841.21	0.31
9	合计	393,564,974.57	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	240,956.00	0.06
B	采矿业	14,823,307.60	3.78
C	制造业	110,787,507.69	28.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,906,792.10	4.32
E	建筑业	14,510,472.52	3.71
F	批发和零售业	9,596,923.45	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	7,421,370.34	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,179,316.95	3.11
J	金融业	136,189,147.37	34.77
K	房地产业	24,326,190.20	6.21
L	租赁和商务服务业	4,647,960.00	1.19

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,304,800.00	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,134,174.06	0.80
S	综合	-	-
	合计	356,068,918.28	90.92

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	3,658,530.00	0.93
C	制造业	7,401,615.52	1.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	159,193.31	0.04
F	批发和零售业	2,161,971.13	0.55
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	1,567,875.20	0.40
J	金融业	216,673.50	0.06
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	15,165,858.66	3.87

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

5.3 报告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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	787,000	26,883,920.00	6.86
2	600036	招商银行	727,000	13,086,000.00	3.34
3	600016	民生银行	1,177,700	10,905,502.00	2.78
4	601166	兴业银行	670,000	10,699,900.00	2.73
5	600690	青岛海尔	977,138	9,908,179.32	2.53
6	001979	招商蛇口	577,771	9,232,780.58	2.36
7	601601	中国太保	297,818	8,562,267.50	2.19
8	000895	双汇发展	339,800	8,015,882.00	2.05
9	600519	贵州茅台	25,700	7,656,287.00	1.95
10	600900	长江电力	541,102	7,196,656.60	1.84

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002792	通宇通讯	76,068	3,931,194.24	1.00
2	002791	坚朗五金	58,800	2,877,672.00	0.73
3	600297	广汇汽车	237,700	2,141,677.00	0.55
4	601699	潞安环能	237,000	1,898,370.00	0.48
5	300508	维宏股份	10,383	1,469,194.50	0.38

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,112,000.00	5.14
	其中：政策性金融债	20,112,000.00	5.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	40,848.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,152,848.00	5.15

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	140302	14 进出 02	100,000	10,112,000.00	2.58
2	160209	16 国开 09	100,000	10,000,000.00	2.55
3	110032	三一转债	370	40,848.00	0.01

5.6 报告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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	41,784.50
2	应收证券清算款	626,394.16
3	应收股利	-
4	应收利息	477,433.20
5	应收申购款	75,229.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,220,841.21

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	40,848.00	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002792	通宇通讯	3,931,194.24	1.00	新股锁定
2	002791	坚朗五金	2,877,672.00	0.73	新股锁定
3	300508	维宏股份	1,469,194.50	0.38	新股锁定

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	304,252,694.84
报告期期间基金总申购份额	17,824,656.92
减：报告期期间基金总赎回份额	26,818,306.79
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	295,259,044.97

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.00

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末运用固有资金对本基金进行交易。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全沪深 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、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 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。

兴业全球基金管理有限公司
2016 年 10 月 26 日