

富国沪深300增强证券投资基金

2014 半年度报告摘要

的半年度报告正文
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动
7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	600030	中信证券	65,030,903.75	2.13
2	601668	中国建发	55,933,232.78	1.84
3	600858	大舜转债	52,321,707.96	1.72
4	601299	中国铁物	51,536,179.80	1.70
5	601006	大秦铁路	42,688,555.45	1.41
6	000033	美的集团	37,047,677.09	1.22
7	000024	招商地产	36,307,843.72	1.21
8	002236	大舜转债	36,307,843.72	1.21
9	601318	中国平安	34,567,143.31	1.16
10	000423	烟台冰厂	33,327,162.50	1.11
11	600519	贵州茅台	33,582,020.05	1.11
12	601088	中国神华	32,185,055.05	1.06
13	000776	广发证券	31,234,045.36	1.04
14	600123	华发股份	29,878,978.84	0.98
15	600481	双良节能	27,106,539.27	0.89
16	000540	天业股份	26,464,295.84	0.87
17	600038	哈飞股份	25,960,562.98	0.85
18	600180	华发股份	25,792,130.48	0.85
19	600749	南都电源	24,129,202.41	0.80
20	600770	恒顺山	23,844,433.53	0.78

注:“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	601668	中国建发	65,340,403.49	2.13
2	601006	大秦铁路	54,688,776.23	1.80
3	000002	万科A	52,065,937.14	1.71
4	600104	上汽集团	48,535,945.39	1.60
5	000066	东北证券	47,012,742.58	1.55
6	000050	深天马A	46,828,708.78	1.50
7	000725	东方汇	45,450,555.29	1.50
8	601399	中国神华	36,307,843.72	1.21
9	000024	招商地产	35,759,135.78	1.19
10	600737	中航安玻	35,352,343.89	1.16
11	002081	金麒麟	34,397,302.16	1.13
12	002146	荣安发展	32,450,978.07	1.07
13	601428	东方汇	32,007,753.62	1.06
14	600151	航天机电	31,328,253.73	1.05
15	601318	中国平安	31,581,175.88	1.04
16	601166	兴业银行	31,463,900.89	1.04
17	600352	浙江龙盛	30,633,055.35	1.01
18	000538	云南铜业	30,019,648.08	1.01
19	000911	宁夏恒力	29,571,884.86	0.97
20	002142	宁波银行	28,580,915.63	0.94

注:“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。
7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本(成交金额)	2,209,632,370.63
卖出股票收入(成交金额)	3,382,994,534.54

注:“买入股票成本(成交金额)”和“卖出股票收入(成交金额)”按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按市值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	国债券	13,085,057.70	0.48
2	央行票据	—	—
3	金融债	—	—
4	企业债	—	—
5	中期票据	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—
8	合计	13,085,057.70	0.48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019322	13,085,057.70	0.30
2	019314	48,590	0.18

7.7 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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据基金合同的约定,不允许投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 报告期末报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况

本基金投资的中国平安于2013年10月15日公告控股子公司平安证券近日收到《中国证券监督管理委员会行政处罚决定书》(2013)408号,中国证监会决定对平安证券给予警告,没收其业务收入760.31万元,没收其违法所得14.71万元,并处以罚款14.71万元。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,有在基金合同规定备选股票库之外的股票

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 报告期末本基金投资的前十名股票中,有在基金合同规定备选股票库之外的股票

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在在基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.4 报告期末持有处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因组合内八只股票,投资组合报告期末占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

8 基金持有人信息

序号	名称	金额
1	存在保证金	532,952.41
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	404,599.49
5	应收申购款	355,522.96
6	其他应收款	—
7	预收账款	—
8	其他	—
9	合计	1,293,074.86

7.2.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因组合内八只股票,投资组合报告期末占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

8.1 基金持有人信息

序号	名称	金额
1	存在保证金	532,952.41
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	404,599.49
5	应收申购款	355,522.96
6	其他应收款	—
7	预收账款	—
8	其他	—
9	合计	1,293,074.86

7.2.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因组合内八只股票,投资组合报告期末占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

8.2 基金持有人信息

序号	名称	金额
1	存在保证金	532,952.41
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	404,599.49
5	应收申购款	355,522.96
6	其他应收款	—
7	预收账款	—
8	其他	—
9	合计	1,293,074.86

7.2.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因组合内八只股票,投资组合报告期末占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

8.3 基金持有人信息

序号	名称	金额
1	存在保证金	532,952.41
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	—
4	应收股利	404,599.49
5	应收申购款	355,522.96
6	其他应收款	—
7	预收账款	—
8	其他	—
9	合计	1,293,074.86

7.2.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.7 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因组合内八只股票,投资组合报告期末占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

7.12.8 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.9 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.10 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.11 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.13 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.14 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.16 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.17 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.18 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.19 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.20 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.21 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.22 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.23 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.24 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.25 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.26 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.27 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.28 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.29 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.30 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.31 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.32 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.33 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.34 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.35 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.36 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.37 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.38 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.39 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.40 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.41 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.42 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。