

兴全沪深300指数增强型证券投资基金 (LOF)

2015 半年度报告摘要

7.30 期末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
7.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	760,000	62,274,400.00	7.43
2	600036	招商银行	1,670,000	31,262,400.00	3.73
3	001916	兴业银行	1,310,000	22,746,000.00	2.73
4	601001	浦发银行	680,000	19,880,400.00	2.37
5	600000	浦发银行	1,080,000	18,376,000.00	2.21
6	000866	双汇发展	760,700	16,417,701.00	1.98
7	601328	交通银行	1,980,000	16,315,200.00	1.96
8	600030	中信证券	600,000	16,146,000.00	1.93
9	600016	民生银行	1,397,328	12,994,840.32	1.55
10	600741	华闻汽车	580,000	12,385,000.00	1.48

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

7.3.2 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

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	金辉矿业	487,000	9,496,760.00	1.13
2	000664	哈药股份	627,000	7,549,080.00	0.90
3	000933	神火股份	458,000	4,314,360.00	0.51
4	600123	兰花科创	358,000	4,210,000.00	0.50
5	000406	金亚传媒	78,796	3,089,220.72	0.34
6	000726	鲁信创投	10,000	2,410,000.00	0.29

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

7.4 报告期内股票投资组成的重大变动
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	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	76,460,325.76	4,077,400.00	0.47
2	600028	招商银行	38,188,731.62	1,977,400.00	0.24
3	601001	浦发银行	25,523,000.00	1,380,000.00	0.16
4	601001	浦发银行	24,483,128.47	1,300,000.00	0.15
5	601001	浦发银行	18,203,120.79	1,077,000.00	0.13
6	600036	招商银行	17,471,062.78	1,077,000.00	0.13
7	600000	浦发银行	8,410,152.00	1,077,000.00	0.13
8	601328	交通银行	6,840,152.00	1,077,000.00	0.13
9	000866	双汇发展	8,400,438.28	1,077,000.00	0.13
10	600016	民生银行	7,942,740.00	1,077,000.00	0.13
11	601360	兴发集团	7,440,000.00	1,077,000.00	0.13
12	601001	浦发银行	6,144,755.00	1,077,000.00	0.13
13	601001	浦发银行	5,844,690.00	1,077,000.00	0.13
14	601001	浦发银行	4,040,560.00	1,077,000.00	0.13
15	600036	招商银行	4,400,000.00	1,077,000.00	0.13

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

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	1,201,500,000.00	61,411,000.00	6.41
2	600036	招商银行	113,180,000.00	6,600,000.00	0.69
3	601001	浦发银行	61,011,750.00	2,750,000.00	0.27
4	600000	浦发银行	61,011,750.00	2,750,000.00	0.27
5	601001	浦发银行	40,032,794.27	2,460,000.00	0.25
6	601001	浦发银行	38,977,231.13	2,460,000.00	0.25
7	600036	招商银行	40,588,576.82	2,460,000.00	0.25
8	600036	招商银行	39,452,103.00	2,460,000.00	0.25
9	600036	招商银行	33,962,047.56	2,460,000.00	0.25
10	600036	招商银行	31,227,089.69	2,460,000.00	0.25
11	600036	招商银行	28,566,059.71	2,460,000.00	0.25
12	600036	招商银行	27,001,800.72	2,460,000.00	0.25
13	601318	中国平安	27,001,800.72	2,460,000.00	0.25
14	601318	中国平安	26,566,059.71	2,460,000.00	0.25
15	600000	浦发银行	26,566,059.71	2,460,000.00	0.25
16	600036	招商银行	24,649,690.81	2,460,000.00	0.25
17	601001	浦发银行	24,483,128.47	2,460,000.00	0.25
18	601001	浦发银行	23,044,726.00	2,460,000.00	0.25
19	601001	浦发银行	22,746,000.00	2,460,000.00	0.25

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本及卖出股票的收入总额

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	民生证券	-	-	-	-
2	民生银行	-	-	-	-
3	金融债	-	-	-	-
4	金融债	-	-	-	-
5	金融债	-	-	-	-
6	金融债	-	-	-	-
7	金融债	-	-	-	-
8	金融债	-	-	-	-
9	合计	-	-	-	-

7.5 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	占基金资产净值比例(%)
1	140223	14国开23	200,000	20,080,000.00	2.40
2	140444	14国开44	100,000	10,036,000.00	1.20
3	140218	14国开18	100,000	10,006,000.00	1.19
4	120229	12国开29	100,000	10,000,000.00	1.18
5	130001	13国债01	900,000	9,000,000.00	1.07

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

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

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

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内前十名股票的主持人本期末未出现被监管部门立案调查，并且在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 期末持有的前十名股票中持有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末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	占基金资产净值比例(%)
1	140223	14国开23	200,000	20,080,000.00	2.40
2	140444	14国开44	100,000	10,036,000.00	1.20
3	140218	14国开18	100,000	10,006,000.00	1.19
4	120229	12国开29	100,000	10,000,000.00	1.18
5	130001	13国债01	900,000	9,000,000.00	1.07

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

7.12.5 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.6 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.7 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.8 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.9 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.10 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.11 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.12 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.13 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.14 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.15 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.16 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.17 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.18 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.19 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.20 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.21 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.22 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.23 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.24 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.25 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.26 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.27 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.28 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.29 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.30 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.31 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.32 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.33 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.34 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.35 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.36 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.37 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.38 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.39 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.40 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.41 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.42 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.43 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.44 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.45 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.46 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.47 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.48 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.49 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.50 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.51 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.52 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.53 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.54 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.55 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.56 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.57 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.58 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.59 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.60 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.61 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.62 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.63 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.64 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.65 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.66 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.67 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.68 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.69 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.70 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.71 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.72 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.73 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.74 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.75 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.76 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.77 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.78 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.79 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.80 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.81 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.82 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.83 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.84 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.85 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.86 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.87 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.88 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.89 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.90 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.91 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.92 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.93 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.94 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.95 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.96 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.97 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.98 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.99 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.100 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.101 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.102 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明

7.12.103 期末持有的股票中持有在流通受限情况的说明