兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2015年8月26日

§1 重要提示

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。本半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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8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。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2015年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全有机增长混合
场内简称	–
基金主代码	340008
前端交易代码	–
后端交易代码	–
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年3月25日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	463,174,309.12份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	–
上市日期	–

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于有机增长能力强的公司,获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方法,定性与定量研究相结合,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。并借鉴海外有机增长的研究成果,构建“兴业有机增长筛选系统”,将有机增长投资作为本基金股票组合投资的核心理念。
业绩比较基准	中信标普300指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,预计长期平均风险与收益低于股票型证券投资基金,高于可转债、债券型、货币型证券投资基金,属于中高风险、中高收益的证券投资基金品种。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓蓥	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099,021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015年1月1日 – 2015年6月30日)
本期已实现收益	696,717,952.65
本期利润	648,214,155.06
加权平均基金份额本期利润	1.0406
本期基金份额净值增长率	55.69%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.6037
期末基金资产净值	1,251,077,680.95
期末基金份额净值	2.7011

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。

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
过去一个月	-10.23%	3.02%	-3.49%	1.73%	-6.74%	1.29%
过去三个月	17.74%	2.31%	6.93%	1.30%	10.81%	1.01%
过去六个月	55.69%	1.85%	15.02%	1.12%	40.67%	0.73%
过去一年	69.52%	1.71%	47.29%	0.91%	22.23%	0.80%
过去三年	145.18%	1.59%	45.16%	0.73%	100.02%	0.86%
自基金合同生效起至今	170.11%	1.36%	56.49%	0.76%	113.62%	0.60%

注:本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:中信标普300指数选择中国A股各行业上市公司中自由流通市值最大、流动性佳且财务稳健的300家公司作为样本股,描述了中国A股市场的总体趋势。中信标普国债指数是中信证券股份有限公司编制发布的上海证券交易所国债市场基准指数,样本涵盖剩余期限一年以上的所有上交所市场国债(含浮息券),描述了上交所国债市场的总体趋势。

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 =50%×(中信标普300指数t / 中信标普300指数t-1 -1)+45%×(中信标普国债指数t / 中信标普国债指数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2015年6月30日。

2、按照《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2009年3月25日至2009年9月25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。

§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(以下简称“公司”或“本公司”)是经证监基金字[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”,公司注册资本由9800万元变更为1.2亿元人民币。 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1.5亿元人民币,其中两股东出资比例不变。

截止2015年6月30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		
吴圣涛	本基金、兴全商业模式优选股票型基金(LOF)基金经理	2014年12月8日	–	13年	经济学硕士,历任汉唐证券研究员,国泰人寿保险有限责任公司投资经理,华富基金管理有限公司基金经理,东吴基金管理有限公司基金经理。
李龙俊	本基金基金经理	2014年11月24日	–	8年	经济学硕士,历任中海基金管理有限公司行业研究员、国金证券有限公司行业研究员、兴业全球基金管理有限公司行业研究员。

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、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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、考察是否存在非公平的因素。

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 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

上半年沪深300、中证500和创业板指分别涨了29.37%、68.83%、95.78%。过去7个月,市场经历了剧烈的波动,这在国内资本市场历史上也是罕见的。

1–3月,市场还处于较温和的上涨过程中。4–5月,市场进入加速上涨阶段,大批小市值股票出现连续缩量涨停的局面。6月中旬,市场发生逆转,大批小市值股票进入连续缩量跌停的局面。

1–5月,本基金基本将仓位维持在契约规定的上限,但品种并没有非常激进。5月下旬出于对市场不理性的担忧,将基金的仓位进行了下降,并一直将仓位保持至上半年末。品种方面,还是持有符合新兴产业方向的成长股,没有切换到大蓝筹。

4.4.2 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55.69%,同期业绩比较基准收益率15.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济仍然处于弱势探底的态势,预计今年下半年或明年上半年有望企稳。

6月份市场的变化,更多是流动性和预期逆转的问题。清理场外配资延缓了资金的流入,使市场的资金供需出现了变化。由于杠杆资金具有强平的性质和杠杆资金的平仓线呈阶梯状分布,当市场开始下跌后,出现了连锁的被强制卖出的现象。这种局面的打破需要政府的强力介入,目前我们也看到政府在积极筹措方法来稳定股市。

这波下跌对人气的伤害是严重的,预计人气的恢复将需要较长时间。但杠杆资金的退出有利于股市下阶段的健康运行。展望下半年,我们预计市场赚钱的难度会非常大,我们将会保持较低的仓位进行操作,直至市场的人气出现恢复。持仓品种方面,未来的方向将集中于传统的白马成长股。

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》、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内本基金未进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

4.8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

本托管人依据《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》,自2009年3月25日起托管兴业有机增长灵活配置(即更名后的“兴全有机增长灵活配置”)混合型证券投资基金(以下称“本基金”)的全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		334,373,393.00	101,449,728.52
结算备付金		2,947,342.00	7,183,848.07
存出保证金		1,599,294.27	1,603,617.51
交易性金融资产		869,270,197.60	1,340,510,216.58
其中:股票投资		827,623,547.90	1,105,004,548.38
基金投资		–	–
债券投资		41,646,649.70	235,505,668.20
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		150,957,306.09	–
应收证券清算款		–	6,466,467.34
应收利息		1,321,908.35	364,898.40
应收股利		–	–
应收申购款		1,626,742.46	2,731,090.03
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		1,362,096,183.77	1,460,309,866.45
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		–	–
应付证券清算款		64,727,884.70	–
应付赎回款		41,669,413.04	18,014,371.04
应付管理人报酬		1,886,787.55	2,090,670.74
应付托管费		314,464.58	348,445.13
应付销售服务费		–	–
应付交易费用		1,976,744.27	2,774,971.62
应交税费		–	–
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债		443,208.68	364,314.97
负债合计		111,018,502.82	23,592,773.50
所有者权益:			
实收基金		463,174,309.12	828,109,260.78
未分配利润		787,903,371.83	608,607,832.17
所有者权益合计		1,251,077,680.95	1,436,717,092.95
负债和所有者权益总计		1,362,096,183.77	1,460,309,866.45

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值2.7011元,基金份额总额463,174,309.12份。

6.2 利润表

会计主体:兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		668,639,499.53	141,877,809.70
1.利息收入		3,560,973.44	5,382,040.80
其中:存款利息收入		2,311,688.71	3,992,866.53
债券利息收入		1,233,817.80	601,856.39
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		15,466.93	787,317.88
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以“-”填列)		712,339,934.69	38,180,326.88
其中:股票投资收益		672,618,240.63	34,664,744.50
基金投资收益		–	–
债券投资收益		38,451,601.65	91,340.00
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		1,270,092.41	3,424,242.38
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-48,503,797.59	96,707,156.07
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		–	–
5.其他收入(损失以“-”号填列)		1,242,388.99	1,608,285.95
减:二、费用		20,425,344.47	25,961,268.02
1. 管理人报酬		10,661,323.31	16,632,123.53
2. 托管费		1,776,887.19	2,772,020.58
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		7,807,556.09	6,389,498.30
5. 利息支出		11,336.67	5,747.95
其中:卖出回购金融资产支出		11,336.67	5,747.95
6. 其他费用		168,241.21	161,877.66
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		648,214,155.06	115,916,541.68
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		648,214,155.06	115,916,541.68

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日 至 2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	828,109,260.78	608,607,832.17	1,436,717,092.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	648,214,155.06	648,214,155.06
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)	-364,934,951.66	-468,918,615.40	-833,853,567.06
其中:1.基金申购款	280,701,942.06	340,827,659.31	621,529,601.37
2.基金赎回款	-645,636,893.72	-809,746,274.71	-1,455,383,168.43
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)	463,174,309.12	787,903,371.83	1,251,077,680.95
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	847,496,843.03	254,749,245.87	1,102,246,088.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	–	115,916,541.68	115,916,541.68
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)	621,519,119.70	501,106,120.76	1,122,625,240.46
其中:1.基金申购款	1,548,733,852.01	1,044,286,032.65	2,593,019,884.66
2.基金赎回款	-927,214,732.31	-543,179,911.89	-1,470,394,644.20
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)	1,469,015,962.73	871,771,908.31	2,340,787,871.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金(原名兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金)(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[2008]1395号文《关于核准兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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2009年3月25日正式生效,首次设立募集规模为1,980,254,871.35份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于2010年1月1日起更名为兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金,股票投资比例为基金资产的30%-80%;债券投资比例为基金资产的0%-65%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的5%。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的80%。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为中信标普300指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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2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。

6.4.3 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2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。详见6.4.5。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号关于发布《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》的通知的要求,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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局财政字决定,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、国家税务总局财政字决定,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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未租用关联方交易单元,故均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,661,323.31	16,632,123.53
其中:支付销售机构的客户维护费	2,308,402.31	3,615,767.90

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,776,887.19	2,772,020.58

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	334,373,393.00	2,261,249.73	3,923,141.15	

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2015年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
600401	*ST海润	2014年9月16日	2015年9月14日	非公开发行流通受限	7.72	3.82	3,210,000	24,781,200.00	12,262,200.00	–
600401	*ST海润	2015年5月28日	2015年9月14日	非公开发行流通受限-转增	–	3.82	6,420,000	–	24,524,400.00	注1
300004	南风股份	2014年6月24日	2015年7月14日	非公开发行流通受限	28.43	66.62	180,000	5,117,400.00	11,991,600.00	–
300336	新文化	2015年2月10日	2016年2月12日	非公开发行流通受限	26.75	16.56	300,000	8,025,000.00	4,968,000.00	–
300336	新文化	2015年5月26日	2016年2月12日	非公开发行流通受限-转增	–	16.56	360,000	–	5,961,600.00	注2

注1:本基金持有的非公开发行股票*ST海润,于2015年5月28日实施2014年度资本资本公积金转增股本方案,以资本公积金向全体股东每10股转增20股。本基金新增6,420,000股。

注2:本基金持有的非公开发行股票新文化,于2015年5月26日实施2014年度权益分配方案,向全体股东每10股派1元人民币现金;同时,以资本公积金向全体股东每10股转增12股。本基金新增360,000股。

6.4.9.2 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
002527	新时达	2015年6月15日	筹划重大资产重组	24.25	–	–	1,200,000	21,647,860.46	29,100,000.00	–
000963	华东医药	2015年6月26日	筹划定向增发事项	62.50	2015年8月5日	69.20	350,000	19,915,292.64	21,875,000.00	–
002080	中材科技	2015年4月21日	筹划重大资产重组	23.23	–	–	700,000	12,111,896.34	16,261,000.00	–
600587	新华医疗	2015年5月22日	筹划非公开发行股票事项	50.16	2015年7月3日	52.77	300,000	10,121,719.03	15,048,000.00	–
000566	海南海药	2015年6月18日	筹划非公开发行股票事项	40.75	–	–	300,000	15,195,150.27	12,225,000.00	–

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

§7 投资组合报告

7.1 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	827,623,547.90	60.76
	其中:股票	827,623,547.90	60.76
2	固定收益投资	41,646,649.70	3.06
	其中:债券	41,646,649.70	3.06
	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	150,957,306.09	11.08
	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	337,320,735.00	24.76
7	其他各项资产	4,547,945.08	0.33
8	合计	1,362,096,183.77	100.00

7.2 期末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