

兴全合润分级混合型证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11

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	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
7.6 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	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
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	40
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	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.4 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	43
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
10.2 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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合润分级混合型证券投资基金		
基金简称	兴全合润分级混合		
场内简称	兴全合润		
基金主代码	163406		
前端交易代码	-		
后端交易代码	-		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 4 月 22 日		
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,878,329,680.11 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	2010-05-31		
下属分级基金的基金简称	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
下属分级基金场内简称	兴全合润	合润 A	合润 B
下属分级基金的交易代码	163406	150016	150017
报告期末下属分级基金份额总额	3,809,730,203.11 份	27,439,790.00 份	41,159,687.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过定量与定性相结合精选股票，以追求当期收益与实现长期资本增值。		
投资策略	本基金以定性定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。		
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数		
风险收益特征	本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均为中高，属于中	根据本基金合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定，合润 A 份额将表现出低风险、预	根据本基金合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定，合润 B 份额在合润基金份额净值

	高风险、中高收益的基金品种。	期收益较低的风险收益特征。	在一定区间内具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般股票型份额更高的风险特征。
--	----------------	---------------	---------------------------------------

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路368号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		庄园芳	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-155,455,819.14
本期利润	-197,880,589.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0932
本期加权平均净值利润率	-6.06%
本期基金份额净值增长率	-6.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,583,336,731.30
期末可供分配基金份额利润	0.6661
期末基金资产净值	4,221,347,139.50
期末基金份额净值	1.0884
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	182.44%

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	4.19%	1.59%	-0.26%	0.79%	4.45%	0.80%
过去三个月	4.21%	1.55%	-1.57%	0.81%	5.78%	0.74%
过去六个月	-6.65%	2.24%	-11.95%	1.48%	5.30%	0.76%
过去一年	10.16%	2.48%	-22.50%	1.84%	32.66%	0.64%
过去三年	180.53%	1.77%	40.34%	1.47%	140.19%	0.30%
自基金合同生效起至今	182.44%	1.53%	6.60%	1.30%	175.84%	0.23%

注：本基金业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：沪深 300 指数和中证国债指数具有较强的代表性。沪深 300 指数选择中国 A 股市场市值规模最大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股，充分反映了 A 股市场的行业代表性，描述了沪深 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

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：

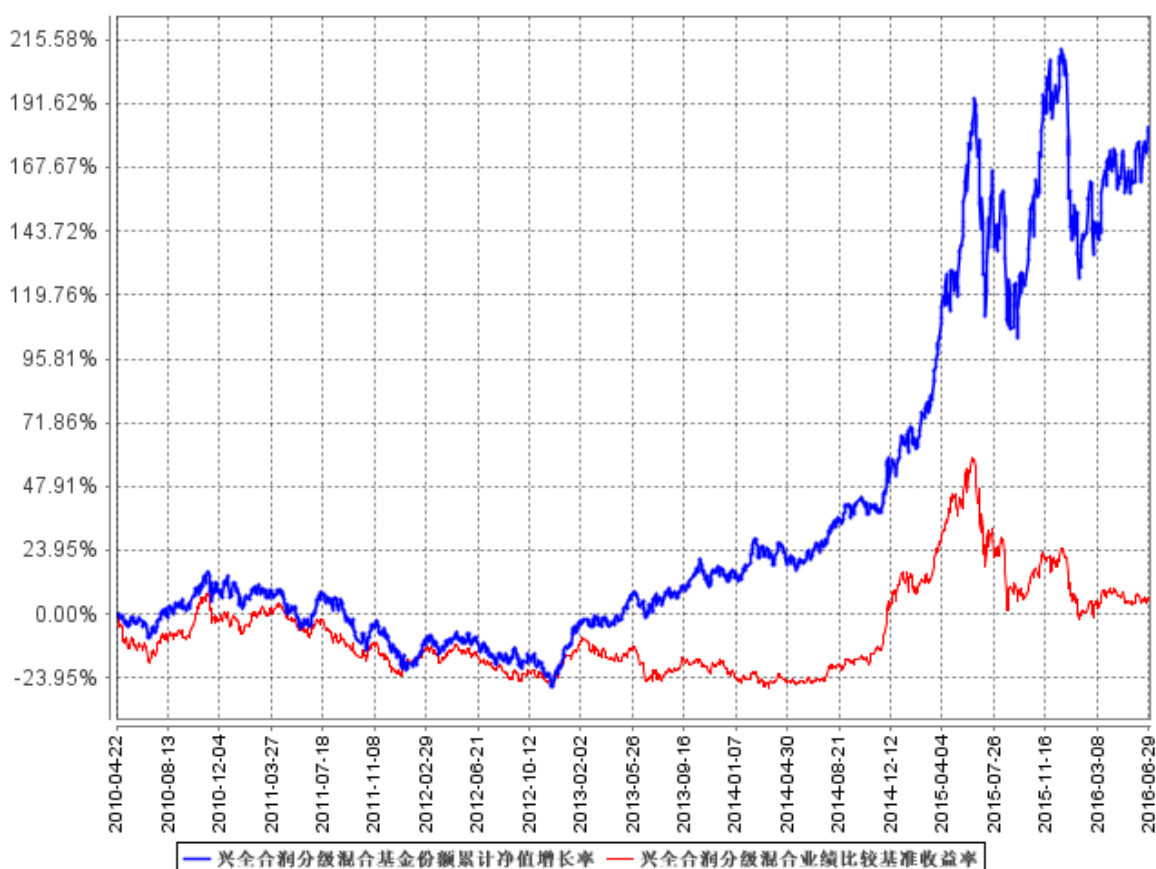
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中证国债指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， 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

兴全合润分级混合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 6 月 30 日。

2、按照《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 4

月 22 日至 2010 年 10 月 21 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 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十七只基金，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、兴全社会责任混合型证券投资基金、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、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

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		
谢治宇	基金管理部投资副总监兼本	2013 年 1 月 29 日	-	8 年	经济学硕士，2007 年加入兴业全球基金管理有

	基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理				限公司，历任行业研究员、专户投资部任投资经理。
--	------------------------------	--	--	--	-------------------------

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、《兴全合润分级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 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

在今年最开始的两周时间内，市场出现了意想不到的变化，但是随后市场就很快进入了稳定的状态。这种较为稳定的状态一直持续到了目前，按照目前的市场状况以及宏观经济的状况，估计这样的情况可能还会持续一段时间。本基金在 2016 年上半年，总体仓位水平变化不大，整体配

置仍以长期价值品种为主，在控制风险的前提下适当关注具有安全边际及较高弹性的品种，结构相对均衡。目前，市场整体估值相对基本面不低，本着风险控制的原则，本基金在持仓结构上较为稳定，坚定持有基本面相对稳健且阶段性行业有向好趋势的品种，均衡配置，降低后期可能出现的大幅波动，更好为投资者创造长期价值。

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-6.65%，同期业绩比较基准收益率-11.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看，实体经济有一定程度的改善，但是长期的结构转型问题依然存在。股市整体相较于一季度来说比较平稳，市场热点切换速度相当迅速。未来，经济面状况依旧复杂，决定股市的各个因素也继续交织。股市在目前的位置观察并不存在显著的高估或者低估的情况，市场恐怕也很难出现趋势性的行情。本基金重点关注那些基本面优秀，具有一定安全边际的中长期价值品种，并且适当参与具有较高弹性的热点品种。但若没有良好的基本面和安全边际支撑，本基金对于纯博弈反弹的品种还是比较谨慎。同时在仓位方面，本基金在控制风险的原则上将及时调整持仓结构，进行均衡配置。全年来看，本基金注重公司基本面和安全边际的逻辑仍然不变，风险收益比是重点关注的因素，旨在为投资者创造长期稳定的超额收益。

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

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行收益分配，运作期内也不单独对合润 A 份额与合润 B 份额进行收益分配。

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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：兴全合润分级混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	278,587,658.71	249,309,630.89

结算备付金		8,259,135.06	17,209,799.54
存出保证金		1,606,124.43	2,325,259.34
交易性金融资产	6.4.7.2	3,942,201,759.60	3,233,772,268.67
其中：股票投资		3,717,157,899.40	3,002,672,062.37
基金投资		-	-
债券投资		225,043,860.20	231,100,206.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
贵金属投资		-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,854,598.85	-
应收利息	6.4.7.5	3,792,672.45	11,917,712.47
应收股利		-	-
应收申购款		7,642,314.60	7,675,936.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,247,944,263.70	3,522,210,607.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	30,778,620.30
应付赎回款		17,373,842.91	4,164,989.20
应付管理人报酬		4,880,397.72	4,307,716.86
应付托管费		813,399.62	717,952.83
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,083,066.95	4,557,801.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	446,417.00	280,418.02
负债合计		26,597,124.20	44,807,498.90
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,494,549,009.87	1,149,363,994.06
未分配利润	6.4.7.10	2,726,798,129.63	2,328,039,114.89
所有者权益合计		4,221,347,139.50	3,477,403,108.95
负债和所有者权益总计		4,247,944,263.70	3,522,210,607.85

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0884 元，基金份额总额为 3,878,329,680.11

份，其中：合润基金份额净值 1.0884 元，份额总额 3,809,730,203.11 份；合润 A 基金份额参考

净值 1.0000 元，份额总额 27,439,790.00 份；合润 B 基金份额参考净值 1.1473 元，份额总额 41,159,687.00 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全合润分级混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		-158,707,252.87	1,141,521,972.22
1.利息收入		3,442,587.57	3,977,167.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	889,107.53	873,699.88
债券利息收入		2,540,946.71	3,103,467.16
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,533.33	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-120,583,218.52	1,167,633,948.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-131,396,640.66	1,150,634,619.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,139,757.42	7,149,963.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	13,953,179.56	9,849,365.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-42,424,770.16	-32,104,431.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	858,148.24	2,015,288.71
减：二、费用		39,173,336.43	33,170,568.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	24,317,739.74	16,045,765.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,052,956.60	2,674,294.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	10,466,840.53	13,685,941.21
5. 利息支出		52,822.26	539,511.95
其中：卖出回购金融资产支出		52,822.26	539,511.95
6. 其他费用	6.4.7.20	282,977.30	225,055.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-197,880,589.30	1,108,351,403.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-197,880,589.30	1,108,351,403.57

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全合润分级混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	1,149,363,994.06	2,328,039,114.89	3,477,403,108.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-197,880,589.30	-197,880,589.30
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）	345,185,015.81	596,639,604.04	941,824,619.85
其中：1.基金申购款	699,827,672.37	1,160,034,914.34	1,859,862,586.71
2.基金赎回款	-354,642,656.56	-563,395,310.30	-918,037,966.86
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）	1,494,549,009.87	2,726,798,129.63	4,221,347,139.50
项目	上年度可比期间 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）	984,532,320.31	605,495,183.94	1,590,027,504.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,108,351,403.57	1,108,351,403.57
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）	-251,845,017.18	-567,957,283.41	-819,802,300.59
其中：1.基金申购款	604,421,298.54	528,140,559.06	1,132,561,857.60

2. 基金赎回款	-856,266,315.72	-1,096,097,842.47	-1,952,364,158.19
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）	732,687,303.13	1,145,889,304.10	1,878,576,607.23

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：

<u> 庄园芳 </u>	<u> 杨东 </u>	<u> 詹鸿飞 </u>
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

兴全合润分级混合型证券投资基金(原名兴业合润分级股票型证券投资基金)(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[2010]229号文《关于核准兴业合润分级股票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于2010年3月22日至2010年4月16日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2010)验字第60467611_B04号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2010年4月22日生效,首次设立募集规模为3,328,967,444.30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,基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴全合润分级股票型证券投资基金,并于2015年8月7日起更名为兴全合润分级混合型证券投资基金。

本基金的基金份额包括合润分级混合型证券投资基金之基础份额(简称“合润基金份额”)、兴全合润A基金份额(简称“合润A份额”)和兴全合润B基金份额(简称“合润B份额”)。合润基金份额在场外进行交易,合润A份额和合润B份额分别在深圳证券交易所上市交易,交易代码不同。合润基金份额在转托管至场内后,可按照4:6的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额,即合润A份额和合润B份额。

本基金的每个运作期为三年,在运作期到期时,合润A份额与合润B份额按届时各自份额净值与合润基金份额净值之比折算为合润基金份额,折算后将所有合润基金份额净值调整为1.0000元,场内的合润基金份额将以4:6的比例分为合润A份额和合润B份额,并进入下一运作期,并

将顺延上一个运作期内合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定。

本基金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。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩基准为 $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证国债指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 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一致。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所

得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于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》及其他相关税务法规和实务操作。另，自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内将全面推开营业税改征增值税。主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于增值税征收范围，不缴纳增值税。
- 2) 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，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；个人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，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
- 4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- 5) 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- 6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	278,587,658.71
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	278,587,658.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,389,492,761.38	3,717,157,899.40	327,665,138.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	135,171,332.67	135,043,860.20
	银行间市场	90,070,560.00	90,000,000.00
	合计	225,241,892.67	225,043,860.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,614,734,654.05	3,942,201,759.60	327,467,105.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	51,825.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,716.70
应收债券利息	3,736,407.92
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	722.70
合计	3,792,672.45

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,082,641.95
银行间市场应付交易费用	425.00
合计	3,083,066.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	64,627.72
预提费用	172,053.70
其他	209,735.58
合计	446,417.00

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全合润分级混合		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,123,414,848.49	1,130,792,986.29
本期申购	387,808,873.79	390,355,776.74
本期赎回(以“-”号填列)	-259,511,970.03	-261,217,188.97
2016 年 4 月 21 日 基金拆分/份额折算前	1,251,711,752.25	1,259,931,574.06
基金拆分/份额折算变动份额	2,014,378,215.35	-
本期申购	806,202,686.43	310,683,937.21
本期赎回(以“-”号填列)	-262,562,450.92	-103,056,960.74
本期末	3,809,730,203.11	1,467,558,550.53

金额单位：人民币元

合润 A	
项目	本期

	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,379,714.00	7,379,714.00
本期申购	475,340.00	475,340.00
本期赎回(以“-”号填列)	-272,168.00	-272,168.00
2016 年 4 月 21 日 基金拆分/份额折算前	7,582,886.00	7,582,886.00
基金拆分/份额折算变动份额	13,582,656.00	-
本期申购	6,810,156.00	5,376,759.68
本期赎回(以“-”号填列)	-535,908.00	-248,257.53
本期末	27,439,790.00	12,711,388.15

金额单位：人民币元

合润 B		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,069,572.00	11,191,293.77
本期申购	713,010.00	720,850.31
本期赎回(以“-”号填列)	-408,252.00	-412,741.17
2016 年 4 月 21 日 基金拆分/份额折算前	11,374,330.00	11,499,402.91
基金拆分/份额折算变动份额	20,373,985.00	-
本期申购	10,215,234.00	3,058,543.16
本期赎回(以“-”号填列)	-803,862.00	-278,874.88
本期末	41,159,687.00	14,279,071.19

注：1、本基金的基金份额包括合润基金份额、合润 A 份额和合润 B 份额。

2、本期申购含转换转入份额、配对转换转入份额，本期赎回含转换转出份额、配对转换转出份额。其中，合润 A 份额、合润 B 份额的本期申购(即配对转换入份额)之和等于兴全合润基金份额配对转换出份额；合润 A 份额、合润 B 份额的本期赎回(即配对转换出份额)之和等于合润基金份额配对转换入份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,146,015,166.65	182,023,948.24	2,328,039,114.89
本期利润	-155,455,819.14	-42,424,770.16	-197,880,589.30
本期基金份额交易产生的变动数	592,777,383.79	3,862,220.25	596,639,604.04
其中：基金申购款	1,206,918,846.08	-46,883,931.74	1,160,034,914.34
基金赎回款	-614,141,462.29	50,746,151.99	-563,395,310.30

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,583,336,731.30	143,461,398.33	2,726,798,129.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	810,289.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	62,966.17
其他	15,851.93
合计	889,107.53

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,681,064,544.84
减：卖出股票成本总额	3,812,461,185.50
买卖股票差价收入	-131,396,640.66

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,139,757.42
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-3,139,757.42

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	328,582,959.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	317,730,134.13
减：应收利息总额	13,992,582.85
买卖债券差价收入	-3,139,757.42

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,953,179.56
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,953,179.56

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-42,424,770.16
——股票投资	-45,248,046.92
——债券投资	2,823,276.76
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-42,424,770.16

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	806,680.55
转换费收入	51,467.69
其他	—
合计	858,148.24

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	10,465,665.53
银行间市场交易费用	1,175.00
合计	10,466,840.53

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	27,847.82
信息披露费	144,205.88
账户维护费用	31,800.00
上市费用	60,000.00
银行费用	19,123.60
合计	282,977.30

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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，基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	1,006,948,507.03	12.37%	1,677,111,808.93	17.09%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	-	-	145,054,451.22	76.55%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
-------	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015年6月30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	-	-	183,400,000.00	10.49%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30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	941,400.84	15.52%	512,669.96	16.63%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	1,535,209.66	21.56%	654,082.57	14.46%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,317,739.74	16,045,765.90
其中：支付销售机构的客户维护费	3,404,903.39	2,399,323.08

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 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×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,052,956.60	2,674,294.27

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		
	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
期初持有的基金份额	4,362,375.11	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	7,032,206.11	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	11,394,581.22	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2938%	-	-

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-

注：1、期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

3、报告期内基金管理人运用固有资金投资合润基础份额，未投资合润 A 份额和合润 B 份额。

4、“期末持有的基金份额占基金总份额比例”指期末持有的基金份额占该类基金总份额的比例。

6.4.10.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资合润基金份额、合润 A 份额、合润 B 份额。

6.4.10.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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
招商银行	278,587,658.71	810,289.43	510,366,982.75	782,636.46

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行收益分配，运作期内也不单独对合润 A 份额与合润 B 份额进行收益分配。

6.4.12 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600758	红阳能源	2015年12月18日	2016年12月15日	非公开发行流通受限	8.01	9.32	6,240,000	49,982,400.00	58,156,800.00	-
002425	凯撒股份	2016年5月6日	2017年5月9日	非公开发行流通受限	21.57	21.64	1,622,600	34,999,482.00	35,113,064.00	-
600162	香江控股	2015年12月24日	2016年12月18日	非公开发行流通受限	6.02	4.08	5,580,000	33,591,600.00	22,766,400.00	-
600162	香江控股	2016年6月27日	2016年12月18日	非公开发行转增	-	4.08	2,790,000	-	11,383,200.00	注1
000690	宝新能源	2016年4月25日	2017年4月26日	非公开发行流通受限	6.90	6.72	5,072,500	35,000,250.00	34,087,200.00	-
300083	劲胜精密	2015年12月28日	2016年12月30日	非公开发行流通受限	31.91	8.12	940,000	29,995,400.00	7,632,800.00	-
300083	劲胜精密	2016年5月30日	2016年12月30日	非公开发行转增	-	8.12	2,820,000	-	22,898,400.00	注2
002427	尤夫股份	2015年7月13日	2016年7月14日	非公开发行流通受限	15.02	19.88	1,330,000	19,976,600.00	26,440,400.00	-
002590	万安科技	2016年2月24日	2017年3月1日	非公开发行流通受限	12.60	19.15	962,600	12,128,760.00	18,433,790.00	-
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-

300508	维宏股份	2016 年 4 月 12 日	2017 年 4 月 19 日	新股流通受限	20.08	254.50	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注 1：本基金持有非公开发行股票香江控股，于 2016 年 6 月 27 日实施 2015 年度资本公积转增股本方案，以资本公积向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 2,790,000 股。

注 2：本基金持有非公开发行股票劲胜精密，于 2016 年 5 月 30 日实施 2015 年度资本公积转增股本方案，以资本公积向全体股东每 10 股转增 30 股。本基金新增 2,820,000 股。

6.4.12.2 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
300284	苏文科	2016 年 5 月 20 日	筹划重大事项	19.49	2016 年 8 月 10 日	21.44	1,577,460	29,365,641.43	30,744,695.40	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	278,587,658.71	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	278,587,658.71
结算备付金	8,259,135.06	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	8,259,135.06
存出保证金	1,606,124.43	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,606,124.43
交易性金融资产	90,000,000.00	17,038,296.00	111,484,069.40	6,381,922.80	139,572.00	3,717,157,899.40	3,942,201,759.60
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,854,598.85	5,854,598.85
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,792,672.45	3,792,672.45
应收申购款	9,840.96	0.00	0.00	0.00	0.00	7,632,473.64	7,642,314.60
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	378,462,759.16	17,038,296.00	111,484,069.40	6,381,922.80	139,572.00	3,734,437,644.34	4,247,944,263.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,373,842.91	17,373,842.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,880,397.72	4,880,397.72
应付托管费	-	-	-	-	-	813,399.62	813,399.62
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,083,066.95	3,083,066.95
其他负债	-	-	-	-	-	446,417.00	446,417.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	26,597,124.20	26,597,124.20
利率敏感度缺口	378,462,759.16	17,038,296.00	111,484,069.40	6,381,922.80	139,572.00	3,707,840,520.14	4,221,347,139.50
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	249,309,630.89	-	-	-	-	-	249,309,630.89
结算备付金	17,209,799.54	-	-	-	-	-	17,209,799.54
存出保证金	2,325,259.34	-	-	-	-	-	2,325,259.34
交易性金融资产	173,639,362.20	-	-	57,460,844.10	-	3,002,672,062.37	3,233,772,268.67
应收利息	-	-	-	-	-	11,917,712.47	11,917,712.47
应收申购款	108,038.48	-	-	-	-	7,567,898.46	7,675,936.94
资产总计	442,592,090.45	-	-	57,460,844.10	-	3,022,157,673.30	3,522,210,607.85

负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	30,778,620.30	30,778,620.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,164,989.20	4,164,989.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,307,716.86	4,307,716.86
应付托管费	-	-	-	-	-	717,952.83	717,952.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,557,801.69	4,557,801.69
其他负债	-	-	-	-	-	280,418.02	280,418.02
负债总计	-	-	-	-	-	44,807,498.90	44,807,498.90
利率敏感度缺口	442,592,090.45	-	-	-57,460,844.10	-	-2,977,350,174.40	3,477,403,108.95

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率 +1%	-875,591.43	-715,808.76
	利率 -1%	889,369.52	733,369.45

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；

权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,717,157,899.40	88.06	3,002,672,062.37	86.35
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	225,043,860.20	5.33	231,100,206.30	6.65
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,942,201,759.60	93.39	3,233,772,268.67	92.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准-10%	-492,223,082.16	-309,166,625.47
	业绩比较基准+10%	492,223,082.16	309,166,625.47

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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	3,717,157,899.40	87.50
	其中：股票	3,717,157,899.40	87.50
2	固定收益投资	225,043,860.20	5.30
	其中：债券	225,043,860.20	5.30
	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	—	—
	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	286,846,793.77	6.75
7	其他各项资产	18,895,710.33	0.44
8	合计	4,247,944,263.70	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

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	147,621,071.80	3.50
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,585,462,082.29	61.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	174,912,801.80	4.14
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	142,783,206.09	3.38
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	325,308,320.50	7.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	34,149,600.00	0.81
L	租赁和商务服务业	66,251,201.80	1.57
M	科学研究和技术服务业	240,669,615.12	5.70
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	3,717,157,899.40	88.06

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300054	鼎龙股份	8,889,448	222,413,988.96	5.27
2	600521	华海药业	8,724,730	212,185,433.60	5.03
3	300012	华测检测	13,776,514	170,553,243.32	4.04
4	002001	新 和 成	7,123,455	150,518,604.15	3.57
5	600584	长电科技	7,346,508	149,060,647.32	3.53
6	002425	凯撒股份	6,747,022	147,850,348.00	3.50
7	600309	万华化学	7,926,021	137,120,163.30	3.25
8	000568	泸州老窖	3,695,813	109,765,646.10	2.60
9	600519	贵州茅台	374,547	109,337,760.24	2.59
10	300271	华宇软件	5,746,359	108,721,112.28	2.58
11	000403	ST 生化	3,486,760	103,173,228.40	2.44
12	002582	好想你	2,480,559	98,031,691.68	2.32
13	300339	润和软件	2,654,738	95,145,809.92	2.25
14	002299	圣农发展	3,553,963	92,047,641.70	2.18
15	002456	欧菲光	2,956,182	87,207,369.00	2.07

16	601199	江南水务	10,625,810	82,668,801.80	1.96
17	000895	双汇发展	3,949,618	82,468,023.84	1.95
18	000858	五 粮 液	2,522,217	82,047,719.01	1.94
19	600073	上海梅林	7,119,006	81,512,618.70	1.93
20	600693	东百集团	11,303,010	75,956,227.20	1.80
21	601689	拓普集团	2,047,717	67,472,275.15	1.60
22	002707	众信旅游	3,263,606	66,251,201.80	1.57
23	002557	洽洽食品	3,509,835	65,423,324.40	1.55
24	000423	东阿阿胶	1,181,895	62,439,512.85	1.48
25	002322	理工环科	3,272,082	61,973,233.08	1.47
26	600758	红阳能源	6,240,000	58,156,800.00	1.38
27	000792	盐湖股份	2,636,900	55,638,590.00	1.32
28	002234	民和股份	1,889,610	55,573,430.10	1.32
29	002009	天奇股份	3,104,597	50,698,069.01	1.20
30	300210	森远股份	2,831,793	50,632,458.84	1.20
31	002439	启明星辰	1,686,378	43,559,143.74	1.03
32	603686	龙马环卫	1,185,000	43,216,950.00	1.02
33	002475	立讯精密	2,143,894	42,127,517.10	1.00
34	300131	英唐智控	3,514,103	41,501,556.43	0.98
35	002339	积成电子	2,260,445	41,230,516.80	0.98
36	002594	比亚迪	665,309	40,590,502.09	0.96
37	002776	柏堡龙	1,107,190	39,371,676.40	0.93
38	300115	长盈精密	1,754,090	36,134,254.00	0.86
39	600498	烽火通信	1,427,396	34,657,174.88	0.82
40	600162	香江控股	8,370,000	34,149,600.00	0.81
41	000690	宝新能源	5,072,500	34,087,200.00	0.81
42	300284	苏交科	1,577,460	30,744,695.40	0.73
43	300083	劲胜精密	3,760,000	30,531,200.00	0.72
44	002268	卫 士 通	779,210	27,848,965.40	0.66
45	603100	川仪股份	1,677,174	26,767,697.04	0.63
46	600105	永鼎股份	2,842,936	26,638,310.32	0.63
47	002427	尤夫股份	1,330,000	26,440,400.00	0.63
48	600297	广汇汽车	2,907,626	25,325,422.46	0.60
49	300297	蓝盾股份	1,471,397	23,439,354.21	0.56
50	002590	万安科技	962,600	18,433,790.00	0.44
51	300124	汇川技术	900,000	17,460,000.00	0.41
52	300379	东方通	209,447	16,646,847.56	0.39
53	000333	美的集团	515,150	12,219,358.00	0.29
54	300369	绿盟科技	170,979	7,234,121.49	0.17

55	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.06
56	300370	安控科技	60,000	681,600.00	0.02
57	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.01
58	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
59	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
60	300512	中亚股份	1,873	187,150.16	0.00
61	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.00
62	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.00
63	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
64	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
65	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
66	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
67	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
68	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
69	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
70	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
71	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

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

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	002425	凯撒股份	190,705,445.70	5.48
2	000333	美的集团	162,153,000.00	4.66
3	600521	华海药业	143,213,614.65	4.12
4	002001	新和成	141,216,704.24	4.06
5	600584	长电科技	137,207,910.18	3.95
6	600309	万华化学	131,107,998.74	3.77
7	601199	江南水务	106,552,507.10	3.06
8	002530	丰东股份	100,931,976.74	2.90
9	600693	东百集团	100,334,429.70	2.89
10	002456	欧菲光	96,273,906.67	2.77
11	000403	ST 生化	96,195,616.55	2.77
12	002582	好想你	94,971,252.56	2.73
13	300271	华宇软件	93,925,692.47	2.70

14	000858	五粮液	93,835,540.80	2.70
15	002007	华兰生物	89,015,428.72	2.56
16	600519	贵州茅台	87,679,154.79	2.52
17	300012	华测检测	86,831,277.43	2.50
18	000895	双汇发展	85,411,507.69	2.46
19	600019	宝钢股份	84,567,904.52	2.43
20	600073	上海梅林	84,224,824.89	2.42
21	000568	泸州老窖	81,971,235.72	2.36
22	002668	奥马电器	80,848,596.26	2.32
23	300339	润和软件	77,730,364.99	2.24
24	600297	广汇汽车	70,280,000.00	2.02

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

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	002458	益生股份	220,982,071.98	6.35
2	300113	顺网科技	177,524,049.03	5.11
3	000333	美的集团	146,864,432.39	4.22
4	002234	民和股份	139,544,892.69	4.01
5	002530	丰东股份	110,132,959.58	3.17
6	300271	华宇软件	106,304,316.92	3.06
7	002554	惠博普	100,477,693.02	2.89
8	002425	凯撒股份	92,627,095.87	2.66
9	002007	华兰生物	90,199,229.66	2.59
10	300063	天龙集团	85,449,676.88	2.46
11	600019	宝钢股份	78,916,099.95	2.27
12	002668	奥马电器	75,027,385.54	2.16
13	002488	金固股份	73,632,292.20	2.12
14	000513	丽珠集团	71,646,783.02	2.06
15	601628	中国人寿	68,698,649.64	1.98
16	603006	联明股份	68,521,831.11	1.97
17	600395	盘江股份	67,902,569.06	1.95
18	600114	东睦股份	65,870,091.06	1.89
19	300059	东方财富	60,763,550.92	1.75
20	002322	理工环科	59,843,275.74	1.72

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	4,572,195,069.45
卖出股票收入（成交）总额	3,681,064,544.84

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。

7.5 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	128,522,365.40	3.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	96,381,922.80	2.28
	其中：政策性金融债	96,381,922.80	2.28
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）	139,572.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	225,043,860.20	5.33

7.6 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	019533	16 国债 05	1,115,510	111,484,069.40	2.64
2	150215	15 国开 15	900,000	90,000,000.00	2.13
3	019518	15 国债 18	170,400	17,038,296.00	0.40
4	018002	国开 1302	59,070	6,381,922.80	0.15
5	113010	江南转债	1,200	139,572.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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交易情况说明**7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1**

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。

7.12.2

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。

7.12.3 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	1,606,124.43
2	应收证券清算款	5,854,598.85

3	应收股利	-
4	应收利息	3,792,672.45
5	应收申购款	7,642,314.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,895,710.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002425	凯撒股份	35,113,064.00	0.83	非公开发行

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
兴全合润分级混合	77,201	49,348.20	2,356,815,702.68	61.86%	1,452,914,500.43	38.14%
合润 A	1,371	20,014.43	2,636,883.00	9.61%	24,802,907.00	90.39%
合润 B	1,567	26,266.55	72,900.00	0.18%	41,086,787.00	99.82%

合计	80,139	48,395.03	2,359,525,485.68	60.84%	1,518,804,194.43	39.16%
----	--------	-----------	------------------	--------	------------------	--------

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

合润 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王辉	2,241,473.00	8.17%
2	高骏	2,231,339.00	8.13%
3	忻存艳	1,452,896.00	5.29%
4	吕玲	1,111,465.00	4.05%
5	江阴市华佳机械有限公司	1,032,069.00	3.76%
6	北京马曼然资产管理有限公司—牛金套利对冲基金	950,000.00	3.46%
7	黄广通	726,609.00	2.65%
8	李娟	575,039.00	2.10%
9	曹华	496,762.00	1.81%
10	刘清	440,000.00	1.60%

合润 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	姜学杰	2,011,155.00	4.89%
2	黄曲荣	1,456,605.00	3.54%
3	黄广通	1,089,914.00	2.65%
4	陈艳玲	1,020,215.00	2.48%
5	侯举超	941,949.00	2.29%
6	张青竹	809,076.00	1.97%
7	蔡尚宗	755,146.00	1.83%
8	王筱春	690,000.00	1.68%
9	陆先海	625,737.00	1.52%
10	汪蓉	613,471.00	1.49%

注：持有人为合润 A、合润 B 基金份额场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴全合润分级混合	5,195,636.88	0.1364%
	合润 A	—	—

	合润 B	—	—
	合计	5,195,636.88	0.1340%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

8.4 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	份额级别	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	兴全合润分级混合	0
	合润 A	0
	合润 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全合润分级混合	>100
	合润 A	0
	合润 B	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
基金合同生效日（2010 年 4 月 22 日） 基金份额总额	2,992,354,444.30	134,645,200.00	201,967,800.00
本报告期期初基金份额总额	1,123,414,848.49	7,379,714.00	11,069,572.00
本报告期基金总申购份额	1,194,011,560.22	7,285,496.00	10,928,244.00
减：本报告期基金总赎回份额	522,074,420.95	808,076.00	1,212,114.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,014,378,215.35	13,582,656.00	20,373,985.00
本报告期期末基金份额总额	3,809,730,203.11	27,439,790.00	41,159,687.00

注：1、本期申购含转换转入份额、配对转换转入份额，本期赎回含转换转出份额、配对转换转出份额。其中，合润 A、合润 B 的本期申购（即配对转换入份额）之和等于兴全合润分级混合配对转换出份额；合润 A、合润 B 的本期赎回（即配对转换出份额）之和等于兴全合润分级混合配对转换入份额。

2、兴全合润分级混合型证券投资基金于 2016 年 4 月 21 日进行了定期份额折算、分拆，其份额净值调整为 1.0000 元。定期份额折算、分拆方案详见 2016 年 4 月 18 日登载的《兴业全球基金管理有限公司关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的公告》。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

2016 年 5 月 9 日公告，自 2016 年 5 月 9 日起公司董事长、法定代表人由兰荣先生变更为庄园芳女士；

2016 年 1 月 13 日公告，自 2016 年 1 月 13 日起郑文惠女士任公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 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、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国泰君安	2	1,780,610,672.07	21.88%	1,302,158.94	21.46%	-
国信证券	1	1,765,125,224.16	21.69%	1,290,838.35	21.28%	-
兴业证券	2	1,006,948,507.03	12.37%	941,400.84	15.52%	-
广发证券	1	712,640,387.92	8.76%	521,154.76	8.59%	-
国金证券	2	627,315,122.41	7.71%	396,023.57	6.53%	-
安信证券	2	583,543,632.41	7.17%	426,746.18	7.03%	-
招商证券	2	486,564,771.62	5.98%	355,824.96	5.86%	-
银河证券	1	399,398,613.20	4.91%	292,078.81	4.81%	-
信达证券	2	366,777,622.94	4.51%	240,965.61	3.97%	-
民生证券	1	250,519,000.32	3.08%	183,206.61	3.02%	-
华创证券	1	134,274,160.30	1.65%	98,195.40	1.62%	-
中信证券	1	25,378,316.66	0.31%	18,559.14	0.31%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	150,017.90	0.12%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	53,944,659.01	41.57%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	75,662,000.30	58.31%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于长期停牌股票（新文化、天龙集团）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
4	关于旗下场内基金份额在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
5	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
6	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 9 日
7	关于长期停牌股票（朗姿股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 9 日

8	关于调整旗下基金在中国邮储银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日
9	关于调整旗下基金在中国银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 12 日
10	关于长期停牌股票（凯撒股份、信质电机、长电科技）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
11	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
12	关于长期停牌股票（三泰控股）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
13	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
14	关于长期停牌股票（康得新）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 16 日
15	关于长期停牌股票（万科 A）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 28 日
16	关于参加爱建证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
17	关于长期停牌股票（青岛海尔）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 1 月 30 日
18	关于调整陆金所资管基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 2 月 15 日
19	关于旗下部分基金投资万安科技（002590）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 2 月 26 日
20	关于长期停牌股票（凯撒旅游）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 2 日
21	关于调整旗下基金在江南农商银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 3 日

22	关于调整旗下基金中信银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 7 日
23	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 8 日
24	关于调整浙江同花顺基金销售有限公司基金申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 14 日
25	关于恢复接受兴全合润分级混合型证券投资基金一百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 16 日
26	关于长期停牌股票（长安汽车）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 3 月 22 日
27	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 11 日
28	关于调整部分基金网上直销转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 18 日
29	关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为兴全合润基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 18 日
30	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算业务期间暂停接受申购、赎回等业务申请的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 18 日
31	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 18 日
32	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务期间合润 A 份额、合润 B 份额停牌的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日

	告		
33	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
34	关于兴全合润分级混合型证券投资基金定期份额折算、分拆结果及恢复交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 25 日
35	关于兴全合润分级混合型证券投资基金之 A 份额、B 份额定期份额折算、分拆后次日前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 25 日
36	关于旗下部分基金投资宝新能源（000690）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 27 日
37	关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 4 月 29 日
38	关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 5 日
39	关于调整诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
40	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日
41	关于旗下部分基金投资凯撒股份（002425）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 10 日
42	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
43	关于长期停牌股票（利欧股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
44	关于旗下部分基金参加民生银行基金通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 12 日
45	关于长期停牌股票（唐德影视）估值	中国证券报、上海证券报、	2016 年 5 月 17 日

	方法调整的公告	证券时报、基金管理人网站	
46	关于调整旗下基金在珠海盈米财富管理有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 5 月 19 日
47	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 3 日
48	关于旗下部分基金投资通裕重工（300185）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 8 日
49	关于长期停牌股票（广电运通）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 15 日
50	关于在上海陆金所资产管理有限公司开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
51	关于调整开放式基金开户证件类型的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 21 日
52	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2016 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全合润分级混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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。

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴业全球基金管理有限公司

2016 年 8 月 24 日