

# 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

## 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	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.....	9
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.....	10

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 .....	10
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	10
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	37
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	40
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	41
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>41</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件.....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>47</b>
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	兴全新视野定期开放混合型发起式
场内简称	-
基金主代码	001511
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	2015年7月1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	4,137,368,478.31 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	本基金通过精选基本面良好，具有盈利能力和市场竞争力的公司，同时通过灵活应用多种绝对收益策略，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例。本基金主要采用市场中性的投资策略，结合多种绝对收益策略，通过定量和定性相结合的方法精选个股，并运用股指期货实现套期保值，力争实现稳定的绝对回报。
业绩比较基准	年化收益率 6%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

### 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	冯晓莲	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
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址）
邮政编码		200122	200041
法定代表人		庄园芳	高建平

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyfunds.com.cn">http://www.xyfunds.com.cn</a>
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	兴业全球基金管理有限公司	上海市浦东新区张杨路 500 号时代广场 19-20 楼

## § 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	90,585,612.09
本期利润	-24,741,861.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0056
本期加权平均净值利润率	-0.56%
本期基金份额净值增长率	-0.19%
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	132,637,326.58
期末可供分配基金份额利润	0.0321
期末基金资产净值	4,270,005,804.89
期末基金份额净值	1.032
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	3.20%
-------------	-------

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

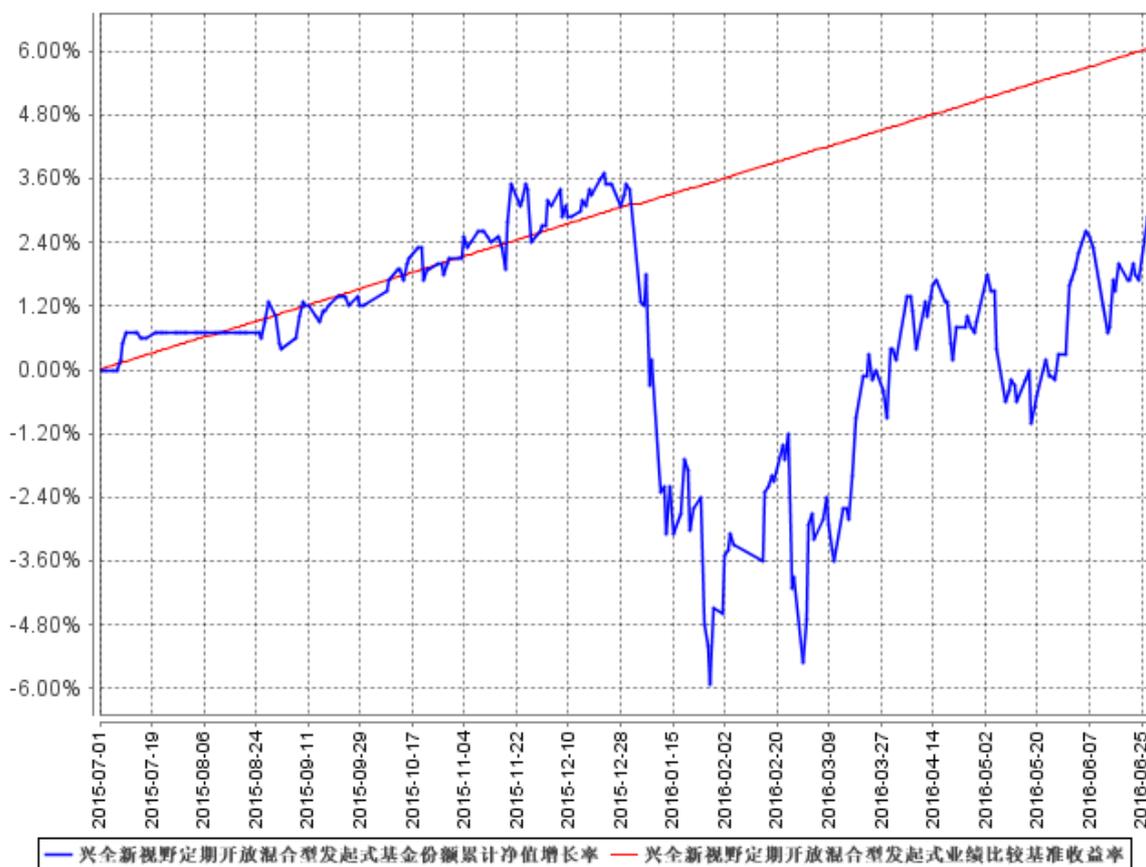
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.57%	0.54%	0.47%	0.02%	1.10%	0.52%
过去三个月	2.79%	0.53%	1.45%	0.02%	1.34%	0.51%
过去六个月	-0.19%	0.79%	2.94%	0.02%	-3.13%	0.77%
自基金合同生效起至今	3.20%	0.58%	6.08%	0.02%	-2.88%	0.56%

注：本基金追求绝对收益，因此以年化收益率 6%作为本基金的业绩比较基准能够比较准确地体现本基金的投资目标。

### 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

兴全新视野定期开放混合型发起式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《兴全新视野定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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本基金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		
董承非	副总经理、基金管理部投资总监，本基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2015 年 7 月 1 日	-	12 年	理学硕士，历任兴业全球基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、基金管理部副总监、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。

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、《兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式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

2016 年上半年沪深 300 指数下跌 15.47%，创业板的跌幅要稍微大一些，为 17.9%。其中市场主要是年初急剧的下跌而后企稳，在一个很窄的区间震荡。其中二季度市场热点轮动不断，具有一定的参与价值。本基金在年初市场大幅度下跌后，适当增加了股票的配置比重，其中以低估值、稳定增长的品种为主，这些品种在二季度表现较好。

### 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-0.19%，同期业绩比较基准收益率 2.94%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国 GDP 增速 6.7%，还是维持了较高的增长。同时贷款、M2、M1 依然超过 10% 以上的速度增长，所以整个市场流动性还是非常充裕的。另外，股票市场通过 IPO 和再融资的量严重低于预期，所以虽然经过一季度急剧的下跌后，市场还是保持了较高的活跃度。另外，监管的加强，

对重组和并购审核的严格，市场的风格也逐渐对蓝筹股绩优股有利。

本基金还是会坚持原来的投资风格，为持有人争取好的回报。

#### 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 年以上相关工作经验，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》、《兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式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，本基金未实施利润分配，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

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合规守信、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基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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：兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金  
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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	722,309,206.09	2,520,449,813.03
结算备付金		264,104,460.50	264,655,604.26
存出保证金		6,407,072.73	1,428,768.02
交易性金融资产	6.4.7.2	2,162,519,444.49	1,978,003,054.12
其中：股票投资		1,824,097,251.89	1,283,573,195.72
基金投资		-	-
债券投资		338,422,192.60	694,429,858.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,111,833,387.83	59,968,467.44
应收利息	6.4.7.5	10,576,623.16	14,473,823.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,277,750,194.80	4,838,979,530.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,459,799.78	4,095,583.60
应付托管费		864,949.93	1,023,895.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,330,132.60	3,102,749.75
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	89,507.60	50,000.00
负债合计		7,744,389.91	8,272,229.24
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,137,368,478.31	4,673,634,207.85
未分配利润	6.4.7.10	132,637,326.58	157,073,093.46
所有者权益合计		4,270,005,804.89	4,830,707,301.31
负债和所有者权益总计		4,277,750,194.80	4,838,979,530.55

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.032 元，基金份额总额 4,137,368,478.31 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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
<b>一、收入</b>		11,266,807.06	-
1.利息收入		22,982,695.95	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,636,562.81	-
债券利息收入		6,103,781.68	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,242,351.46	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		102,031,717.73	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	54,209,710.03	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,871,798.02	-
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	6,561,836.00	-
股利收益	6.4.7.16	31,388,373.68	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-115,327,473.36	-
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	1,579,866.74	-
<b>减：二、费用</b>		36,008,668.33	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,863,269.02	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,465,817.26	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	8,566,677.74	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	112,904.31	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-24,741,861.27	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-24,741,861.27	-

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	4,673,634,207.85	157,073,093.46	4,830,707,301.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-24,741,861.27	-24,741,861.27
三、本期基金份额交易	-536,265,729.54	306,094.39	-535,959,635.15

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	491,471,424.65	-10,487,049.03	480,984,375.62
2.基金赎回款	-1,027,737,154.19	10,793,143.42	-1,016,944,010.77
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)	4,137,368,478.31	132,637,326.58	4,270,005,804.89
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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

注: 本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效, 故不存在上年度可比期间。

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:

\_\_\_\_\_庄园芳\_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_杨东\_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_詹鸿飞\_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券

监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意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募集的批复》(证监许可[2015]1141号文),由兴业全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《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基金合同》发售,基金合同于2015年7月1日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为4,787,173,551.39份基金份额。本基金的基金管理人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2015年6月23日至2015年6月25日募集,募集期间净认购资金人民币4,786,646,979.68元,认购资金在募集期间产生的利息人民币526,571.71元,募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计4,787,173,551.39份。其中,兴业全球基金管理有限公司运用自有资金认购本基金份额10,000,750.00份(含募集期利息结转的份额)。根据《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基金合同》,兴业全球基金管理有限公司承诺持有该认购份额期限不低于三年。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《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基金合同》和《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证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),股指期货、权证,债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合的比例范围为:股票投资比例为基金资产净值的0% 95%;权证投资比例为基金资产净值的0 3%;开放期内的每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内,本基金不受5%的限制,但每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金的业绩比较标准为:年化收益率6%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 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 年上半年的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会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》、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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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[2008]1 号文《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》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。本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收增值税和企业所得税。
- (c) 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、现金对价，

暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 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	722,309,206.09
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	722,309,206.09

### 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	1,894,318,360.27	1,824,097,251.89	-70,221,108.38	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	307,366,000.00	309,652,192.60	2,286,192.60
	银行间市场	28,377,761.09	28,770,000.00	392,238.91
	合计	335,743,761.09	338,422,192.60	2,678,431.51
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	2,230,062,121.36	2,162,519,444.49	-67,542,676.87

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	14,485,400.00	-	-	
IC1609	8,449,040.00	-	-	
IF1609	6,036,360.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	14,485,400.00	-	-	

### 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	648,621.64
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	2,907.27
应收债券利息	9,902,884.69
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	21,311.63
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	897.93
合计	10,576,623.16

**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	3,329,234.95
银行间市场应付交易费用	897.65
合计	3,330,132.60

**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	-
预提费用	89,507.60
合计	89,507.60

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,673,634,207.85	4,673,634,207.85
本期申购	491,471,424.65	491,471,424.65
本期赎回(以“-”号填列)	-1,027,737,154.19	-1,027,737,154.19
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,137,368,478.31	4,137,368,478.31

**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	105,628,387.46	51,444,706.00	157,073,093.46

本期利润	90,585,612.09	-115,327,473.36	-24,741,861.27
本期基金份额交易产生的变动数	-11,915,820.42	12,221,914.81	306,094.39
其中：基金申购款	12,002,789.65	-22,489,838.68	-10,487,049.03
基金赎回款	-23,918,610.07	34,711,753.49	10,793,143.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	184,298,179.13	-51,660,852.55	132,637,326.58

#### 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	15,552,964.30
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	43,920.63
其他	39,677.88
合计	15,636,562.81

#### 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	3,157,998,169.22
减：卖出股票成本总额	3,103,788,459.19
买卖股票差价收入	54,209,710.03

#### 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	9,871,798.02
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	9,871,798.02
----	--------------

#### 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	465,306,272.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	443,456,371.52
减：应收利息总额	11,978,102.69
买卖债券差价收入	9,871,798.02

#### 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

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未进行权证买卖交易。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年6月30日
权证投资收益	-
股指期货-投资收益	6,561,836.00

#### 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	31,388,373.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	31,388,373.68

**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	-119,887,113.36
——股票投资	-119,052,057.99
——债券投资	-835,055.37
——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	4,559,640.00
合计	-115,327,473.36

**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	1,561,411.45
转换费收入	18,455.29
其他收入	-
合计	1,579,866.74

**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	8,564,327.74
银行间市场交易费用	2,350.00
合计	8,566,677.74

**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	39,781.56
信息披露费	49,726.04
账户维护费用	10,500.00

银行手续费	8,096.71
上清所账户维护费	4,800.00
其他费用	-
合计	112,904.31

#### 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、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。

#### 6.4.10 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	5,104,883,207.14	75.03%	-	-

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 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	14,108,986.08	60.24%	-	-

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 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 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	
	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	1,437,800,000.00	100.00%	-	-

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 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	3,763,474.60	77.83%	2,633,076.55	79.09%
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

注：1、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。

2、本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

## 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	21,863,269.02	-
其中：支付销售机构的客户维护费	6,053,360.93	-

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1%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%/当年天数。

2、本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

### 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	5,465,817.26	-

注：1、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。

2、本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

### 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	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30 日
基金合同生效日（2015年7月1日）持有的基金份额	10,000,750.00	-
期初持有的基金份额	10,000,750.00	-

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	10,000,750.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2417%	-

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 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

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。

#### 6.4.10.5 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
兴业银行	722,309,206.09	15,552,964.30	-	-

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，故不存在上年度可比期间。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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
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	628,441	20,053,552.31	5,102,940.92	-

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	1,885,323	-	15,308,822.76	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	2,898,527	19,999,836.30	19,478,101.44	-
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	641,700	8,085,420.00	12,288,555.00	-
002792	通宇通讯	2016年3月21日	2017年3月28日	新股流通受限	22.94	59.80	77,621	1,780,625.74	4,641,735.80	-
002792	通宇通讯	2016年6月7日	2017年3月28日	非公开发行转增	-	59.80	38,810	-	2,320,838.00	注2
002791	坚朗五金	2016年3月22日	2017年3月29日	新股流通受限	21.57	53.77	121,285	2,616,117.45	6,521,494.45	-
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	-
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	-
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	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127003	海印转债	2016年6月15日	2016年7月1日	新债流通受限	100.00	100.00	8,860	886,000.00	886,000.00	-
132006	16皖新EB	2016年6月27日	2016年7月	新债流通受限	100.00	100.00	224,960	22,496,000.00	22,496,000.00	-

			29 日						
--	--	--	------	--	--	--	--	--	--

注 1：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 1,885,323 股。

注 2：本基金持有非公开发行股票通宇通讯，于 2016 年 6 月 7 日实施 2015 年资本公积转增股本方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 38,810 股

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 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。

#### 6.4.13 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。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部和风险管理部向督察长负责，并向首席执行官汇报日常行政事务。

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、

风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	0.00	100,160,000.00
A-1 以下	0.00	-
未评级	0.00	-
合计	-	100,160,000.00

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	7,559,978.60	314,450,198.80
AAA 以下	230,979,214.00	159,819,659.60
未评级	99,883,000.00	120,000,000.00
合计	338,422,192.60	594,269,858.40

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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或因投

资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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，除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，其余金融资产均能及时变现。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **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**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照

合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

#### 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	722,309,206.09	-	-	-	-	-	722,309,206.09
结算备付金	264,104,460.50	-	-	-	-	-	264,104,460.50
存出保证金	2,217,163.93	-	-	-	-	4,189,908.80	6,407,072.73
交易性金融资产	-	-	-	285,581,420.70	24,070,771.90	1,852,867,251.89	2,162,519,444.49
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,111,833,387.83	1,111,833,387.83
应收利息	-	-	-	-	-	10,576,623.16	10,576,623.16
资产总计	988,630,830.52	-	-	285,581,420.70	24,070,771.90	2,979,467,171.68	4,277,750,194.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,459,799.78	3,459,799.78
应付托管费	-	-	-	-	-	864,949.93	864,949.93
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,330,132.60	3,330,132.60
其他负债	-	-	-	-	-	89,507.60	89,507.60
负债总计	-	-	-	-	-	7,744,389.91	7,744,389.91
利率敏感度缺口	988,630,830.52	-	-	285,581,420.70	24,070,771.90	2,971,722,781.77	4,270,005,804.89
本期末 2015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	2,520,449,813.03	-	-	-	-	-	2,520,449,813.03
结算备付金	264,655,604.26	-	-	-	-	-	264,655,604.26
存出保证金	1,428,768.02	-	-	-	-	-	1,428,768.02
交易性金融资产	-	-	100,160,000.00	587,085,661.40	7,184,197.00	1,283,573,195.72	1,978,003,054.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	59,968,467.44	59,968,467.44
应收利息	-	-	-	-	-	14,473,823.68	14,473,823.68
资产总计	2,786,534,185.31	-	100,160,000.00	587,085,661.40	7,184,197.00	1,358,015,486.84	4,838,979,530.55
负债							
应付管理人报	-	-	-	-	-	4,095,583.60	4,095,583.60

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	1,023,895.89	1,023,895.89
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,102,749.75	3,102,749.75
其他负债	-	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	8,272,229.24	8,272,229.24
利率敏感度缺口	2,786,534,185.31	-100,160,000.00	587,085,661.40	7,184,197.00	1,349,743,257.60		4,830,707,301.31

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率下降1%	-	3,598,074.31
	市场利率上升1%	-	-3,529,662.11

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

##### 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	1,824,097,251.89	42.72	1,283,573,195.72	26.57

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	338,422,192.60	7.93	694,429,858.40	14.38
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	2,162,519,444.49	50.64	1,978,003,054.12	40.95

#### 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		
	使用沪深 300 指数所对应的市场组合进行分析		
	在沪深 300 指数变化 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)
	沪深 300 指数上升 10%	169,801,680.13	139,182,278.50
	沪深 300 指数下降 10%	-169,801,680.13	-139,182,278.50

#### 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	1,824,097,251.89	42.64
	其中: 股票	1,824,097,251.89	42.64
2	固定收益投资	338,422,192.60	7.91
	其中: 债券	338,422,192.60	7.91

	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	986,413,666.59	23.06
7	其他各项资产	1,128,817,083.72	26.39
8	合计	4,277,750,194.80	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	-	-
B	采矿业	135,797,394.82	3.18
C	制造业	1,019,622,358.70	23.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	193,910,920.44	4.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	217,930,418.94	5.10
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	2,712,965.90	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	196,524,498.69	4.60
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	57,598,694.40	1.35
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	1,824,097,251.89	42.72

## 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	600297	广汇汽车	25,020,714	217,930,418.94	5.10
2	600886	国投电力	26,429,215	174,432,819.00	4.09
3	600398	海澜之家	13,826,536	156,239,856.80	3.66
4	600048	保利地产	16,999,965	146,709,697.95	3.44
5	600882	华联矿业	13,498,747	135,797,394.82	3.18
6	000662	天夏智慧	5,677,568	122,067,712.00	2.86
7	601100	恒立液压	10,045,201	117,127,043.66	2.74
8	000895	双汇发展	5,224,063	109,078,435.44	2.55
9	000333	美的集团	4,349,081	103,160,201.32	2.42
10	000403	ST生化	3,047,340	90,170,790.60	2.11
11	600584	长电科技	3,871,076	78,544,132.04	1.84
12	000625	长安汽车	5,282,800	72,215,876.00	1.69
13	600066	宇通客车	3,014,089	59,678,962.20	1.40
14	000069	华侨城A	8,999,796	57,598,694.40	1.35
15	600325	华发股份	4,499,982	49,814,800.74	1.17
16	300124	汇川技术	2,096,600	40,674,040.00	0.95
17	300185	通裕重工	2,422,973	21,612,919.16	0.51
18	300083	劲胜精密	2,513,764	20,411,763.68	0.48
19	000690	宝新能源	2,898,527	19,478,101.44	0.46
20	002590	万安科技	641,700	12,288,555.00	0.29
21	002792	通宇通讯	116,431	6,962,573.80	0.16
22	002791	坚朗五金	121,285	6,521,494.45	0.15
23	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.06
24	002594	比亚迪	36,005	2,196,665.05	0.05
25	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.00
26	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.00
27	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
28	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
29	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
30	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
31	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00

32	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
33	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
34	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
35	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	000333	美的集团	743,641,451.71	15.39
2	600297	广汇汽车	417,560,000.00	8.64
3	300413	快乐购	359,636,071.95	7.44
4	600886	国投电力	203,141,485.58	4.21
5	300431	暴风集团	177,180,000.00	3.67
6	600048	保利地产	168,361,537.32	3.49
7	600882	华联矿业	151,135,170.41	3.13
8	000625	长安汽车	150,602,423.95	3.12
9	601100	恒立液压	115,534,692.87	2.39
10	603005	晶方科技	111,800,000.00	2.31
11	000895	双汇发展	103,695,901.33	2.15
12	000166	申万宏源	82,000,000.00	1.70
13	600398	海澜之家	79,973,890.45	1.66
14	600066	宇通客车	63,612,373.99	1.32
15	000069	华侨城 A	63,351,565.55	1.31
16	600376	首开股份	62,471,080.49	1.29
17	600325	华发股份	60,697,827.71	1.26
18	603609	禾丰牧业	60,280,000.00	1.25
19	300185	通裕重工	59,999,930.48	1.24
20	300124	汇川技术	53,160,000.00	1.10

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

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	000333	美的集团	653,307,675.93	13.52
2	300413	快乐购	378,218,266.51	7.83
3	600297	广汇汽车	206,755,687.02	4.28
4	000625	长安汽车	204,382,891.61	4.23
5	300431	暴风集团	171,059,290.71	3.54
6	600886	国投电力	136,997,182.51	2.84
7	002508	老板电器	134,527,788.56	2.78
8	603005	晶方科技	127,840,593.47	2.65
9	601311	骆驼股份	93,645,792.82	1.94
10	000166	申万宏源	82,683,558.53	1.71
11	600376	首开股份	68,916,930.25	1.43
12	300054	鼎龙股份	66,829,205.32	1.38
13	603609	禾丰牧业	63,382,052.83	1.31
14	002152	广电运通	60,185,157.50	1.25
15	600273	嘉化能源	55,573,304.00	1.15
16	002085	万丰奥威	53,355,739.72	1.10
17	300185	通裕重工	48,907,893.89	1.01
18	600882	华联矿业	45,026,428.65	0.93
19	002664	信质电机	44,860,055.22	0.93
20	002244	滨江集团	42,952,056.14	0.89

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	3,763,364,573.35
卖出股票收入（成交）总额	3,157,998,169.22

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	28,770,000.00	0.67
7	可转债（可交换债）	309,652,192.60	7.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	338,422,192.60	7.93

## 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	137002	15 新钢 EB	600,000	58,464,000.00	1.37
2	117009	15 九洲债	400,000	41,100,000.00	0.96
3	117008	15 东集 01	330,200	33,155,382.00	0.78
4	S78054	15 名轩 02	300,000	30,000,000.00	0.70
5	117010	15 中基债	300,000	29,913,000.00	0.70

## 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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1609	IC1609	10	11,740,400.00	3,291,360.00	套保
IF1609	IF1609	8	7,304,640.00	1,268,280.00	套保
公允价值变动总额合计（元）					4,559,640.00
股指期货投资本期收益（元）					6,561,836.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					4,559,640.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示，单位为手。

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货套利策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。

## 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	6,407,072.73
2	应收证券清算款	1,111,833,387.83
3	应收股利	-
4	应收利息	10,576,623.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,128,817,083.72

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	137002	15 新钢 EB	58,464,000.00	1.37
2	117009	15 九洲债	41,100,000.00	0.96
3	137001	15 美克 EB	15,954,000.00	0.37
4	117014	15 大族 EB	11,481,477.00	0.27
5	123001	蓝标转债	702,204.00	0.02

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 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

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
39,354	105,132.10	945,899,277.46	22.86%	3,191,469,200.85	77.14%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	7,125,282.66	0.1722%

### 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：本基金的基金经理也是本公司高级管理人员及基金投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,750.00	0.24	10,000,750.00	0.24	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	4,999,525.00	0.12	4,999,525.00	0.12	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	15,000,275.00	0.36	15,000,275.00	0.36	3年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月1日）基金份额总额	4,787,173,551.39
本报告期期初基金份额总额	4,673,634,207.85
本报告期基金总申购份额	491,471,424.65
减：本报告期基金总赎回份额	1,027,737,154.19
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	4,137,368,478.31

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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——毕马威华振会计师事务所（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	
兴业证券	2	5,104,883,207.14	75.03%	3,763,474.60	77.83%	-

长江证券	1	756,396,615.51	11.12%	477,515.68	9.87%	-
光大证券	1	735,976,269.33	10.82%	464,622.24	9.61%	-
浙商证券	1	206,130,446.12	3.03%	130,129.94	2.69%	-
华泰证券	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
兴业证券	14,108,986.08	60.24%	1,437,800,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	9,310,396.92	39.76%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

### 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、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、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、基金管理人网站	2016 年 1 月 6 日
4	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 7 日
5	关于旗下部分基金投资山东山水水泥集团有限公司中期票据的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 9 日

6	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、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、基金管理人网站	2016 年 1 月 9 日
8	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
9	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
10	关于山东山水水泥中期票据估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
11	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
12	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
13	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 16 日
14	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开放及暂停申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
15	关于兴全新视野定期开放混合型发起式基金参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 21 日
16	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 28 日
17	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 29 日
18	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 30 日

19	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、基金管理人网站	2016 年 2 月 15 日
20	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、基金管理人网站	2016 年 2 月 26 日
21	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、基金管理人网站	2016 年 3 月 2 日
22	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、基金管理人网站	2016 年 3 月 14 日
23	关于增加华夏银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 3 月 17 日
24	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、基金管理人网站	2016 年 3 月 22 日
25	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开放及暂停申购、赎回业务的公告（2016 年第 2 次）	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
26	关于增加农业银行为兴全新视野基金销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 21 日
27	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、基金管理人网站	2016 年 4 月 22 日
28	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、基金管理人网站	2016 年 4 月 27 日
29	关于增加办理兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式基金转换业务销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 4 月 27 日
30	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、基金管理人网站	2016 年 4 月 29 日
31	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、基金管理人网站	2016 年 5 月 5 日
32	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 9 日

		人网站	
33	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
34	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、基金管理人网站	2016 年 5 月 11 日
35	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、基金管理人网站	2016 年 5 月 12 日
36	关于长期停牌股票（唐德影视）估值方法调整的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 5 月 17 日
37	关于旗下部分基金投资通裕重工（300185）非公开发行的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 8 日
38	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、基金管理人网站	2016 年 6 月 15 日
39	关于调整开放式基金开户证件类型类型的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 21 日
40	关于增加诺亚正行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 日
41	关于调整诺亚正行申购、定投金额下限的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 日
42	关于增加众禄金融为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 日
43	关于调整众禄金融申购、定投金额下限的公告	中国证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 日
44	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、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、中国证监会准予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募集注册的文件；
- 2、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基金合同；
- 3、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托管协议；
- 4、关于申请募集注册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的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 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