

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 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：兴全基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 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 2017 年 3 月 30 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。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 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.....	13
§5 托管人报告	13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	58
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注.....	59
§9 基金份额持有人信息.....	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
9.3 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	60
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	61
§10 开放式基金份额变动.....	61
§11 重大事件揭示.....	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变.....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件.....	63
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§13 备查文件目录.....	72
13.1 备查文件目录.....	72
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	72

§ 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	兴全基金管理有限公司
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	5,272,394,417.47 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		兴全基金管理有限公司	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@xqfunds.com	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		上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼28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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

注册登记机构	兴全基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼
--------	------------	------------------------------

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日	2014 年
本期已实现收益	263,701,012.41	106,973,675.54	-
本期利润	204,427,844.16	159,318,112.03	-
加权平均基金份额本期利润	0.0434	0.0336	-
本期加权平均净值利润率	4.18%	3.31%	-
本期基金份额净值增长率	4.55%	3.40%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	409,459,973.14	105,628,387.46	-
期末可供分配基金份额利润	0.0777	0.0226	-
期末基金资产净值	5,701,550,645.24	4,830,707,301.31	-
期末基金份额净值	1.081	1.034	-
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	8.10%	3.40%	-

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。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

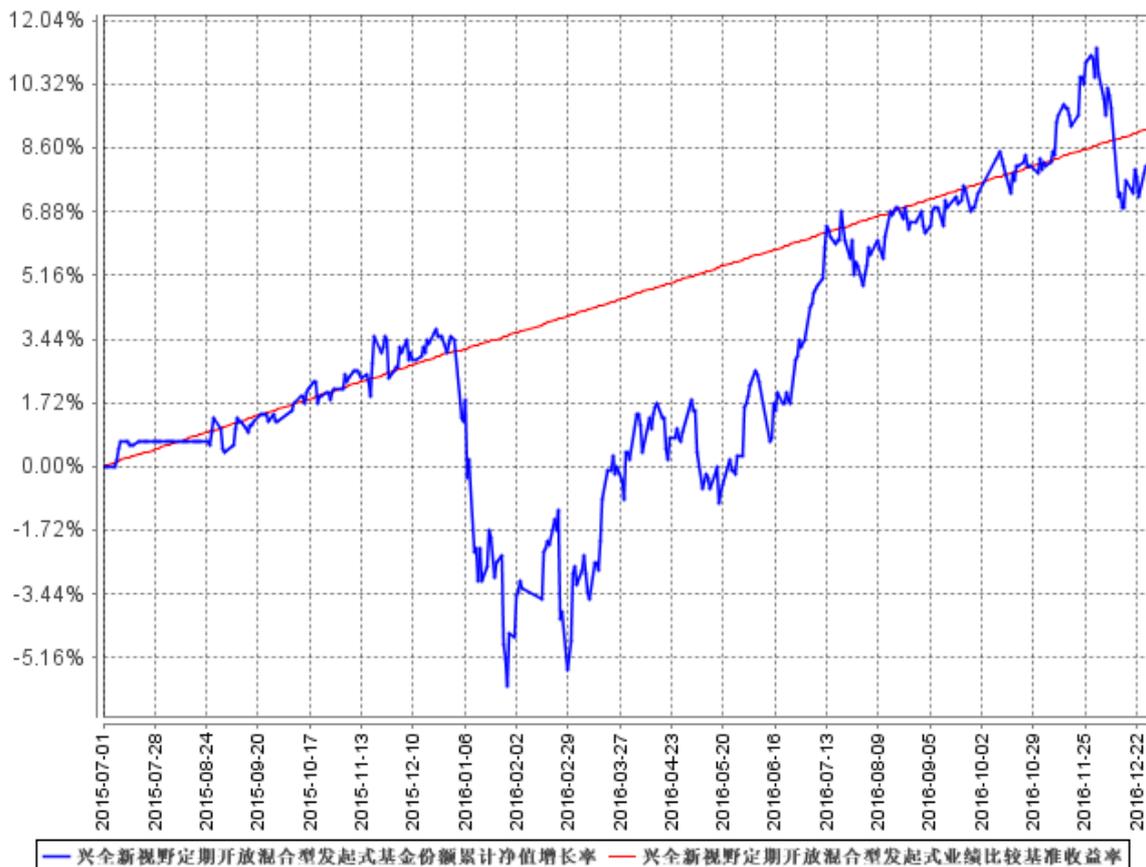
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	0.65%	0.46%	1.41%	0.02%	-0.76%	0.44%
过去六个月	4.75%	0.41%	2.87%	0.02%	1.88%	0.39%
过去一年	4.55%	0.62%	5.90%	0.02%	-1.35%	0.60%
自基金合同生效起至今	8.10%	0.52%	9.13%	0.02%	-1.03%	0.50%

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

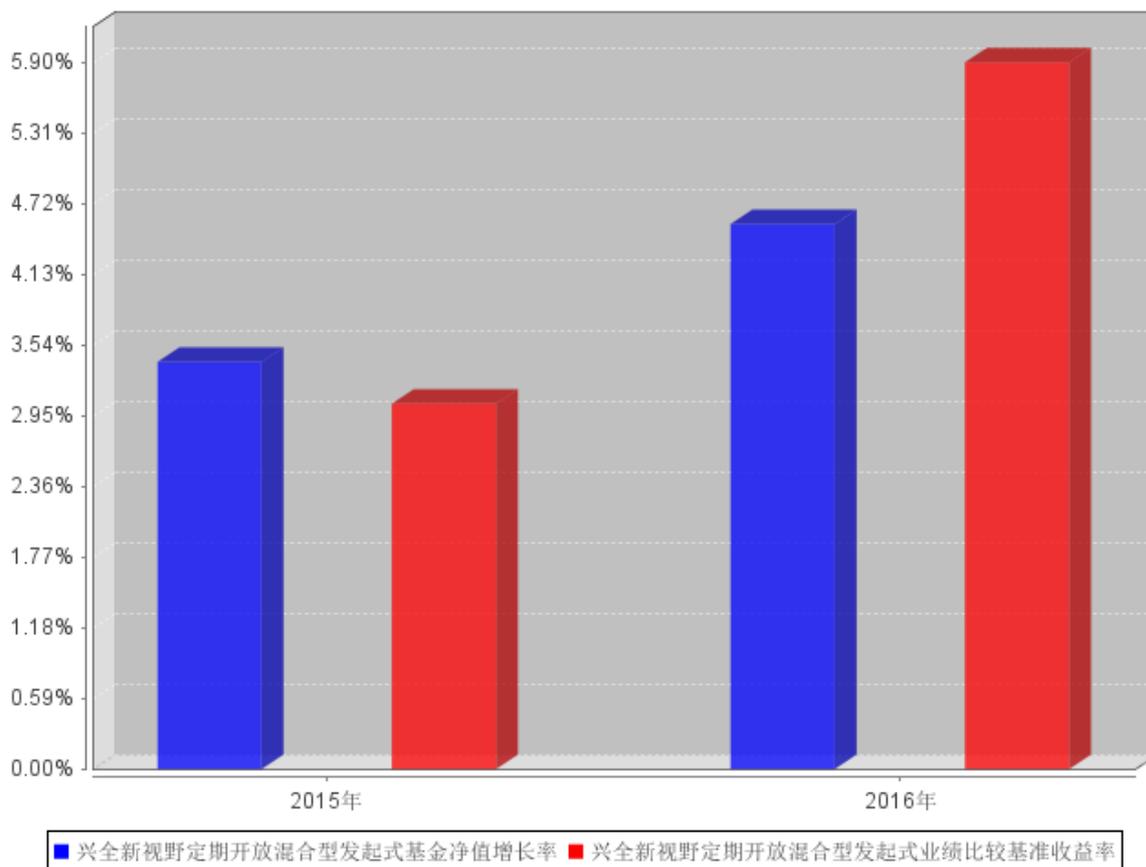


注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 12 月 31 日。

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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全新视野定期开放混合型发起式自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2015 年数据统计期间为 2015 年 7 月 1 日（基金合同生效之日）至 2015 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 7 月 1 日）至 2016 年 12 月 31 日期间未进行利润分配。

§ 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

兴全基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）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，中国证监会批复（证监许可[2008]6 号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008 年 4 月 9 日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由 9800 万元变更为人民币 1.2 亿元，其中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%。2008 年 7 月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号），公司于 2008 年 8 月 25 日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。

截止 2016 年 12 月 31 日，公司旗下管理着十八只基金，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、兴全稳泰债券型证券投资基金。

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，历任兴全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、上海

					兴全睿众资产管理有限 公司执行董事。
--	--	--	--	--	-----------------------

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，本基金存在符合《基金合同》约定的附加管理费提取条件的情况。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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴全基金管理有限公司公平交易制度》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 年市场的开局是以股灾开局，年末的时候又是债灾收尾。对于新视野基金而言，本着稳健运作的想法，虽然在年初股市的熔断过程中，净值也遭受了一些损失，但是跌下来以后新视野基金增加了一些股票的持仓比重，而后一直维持 4 成左右的股票持仓。年末的时候，基于对微观

企业盈利改善的想法，进一步提升了股票的持仓比重。

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 4.55%，同期业绩比较基准收益率 5.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年中国的宏观数据相比 2015 年波澜不惊，但是微观的改变却是巨大的：2015 年企业层面明显感到经营压力巨大，特别是一些资源类和制造类的企业；2016 年，各行各业的微观都先后感受到了暖风吹来，先是煤炭和钢铁行业，进一步延展到有色、水泥、工程机械行业。A 股的投资者对这些变化，显得信心不足，一直质疑其持续性。相应的行业在股价上面虽然有所反映，但是犹犹豫豫。

展望 2017 年，虽然宏观数据依然不会发生比较大的变化。但是微观企业盈利的改善是有望持续的，这对整个市场会形成较大的支撑。虽然相比 2016 年流动性方面可能偏紧些，投资者的心态依然谨慎，但是通过对比各个大类资产，回升的企业盈利，我们判断 2017 年 A 股的回报可能要好于 2016 年。

本基金将坚持稳健价值的投资风格，为持有人争取更高的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司

各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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》与《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》，自 2015 年 7 月 1 日起托管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本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1700711 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	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全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的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“兴全新视野基金”)财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是兴全新视野基金管理人兴全基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的

	有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价兴全基金管理有限公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，兴全新视野基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注 2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了兴全新视野基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果及基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	王国蓓	张楠
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2017 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,269,497,256.20	2,520,449,813.03
结算备付金		271,128,480.51	264,655,604.26
存出保证金		3,473,988.59	1,428,768.02
交易性金融资产	7.4.7.2	4,103,036,637.52	1,978,003,054.12
其中：股票投资		3,291,181,484.12	1,283,573,195.72
基金投资		-	-
债券投资		811,855,153.40	694,429,858.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		55,000,105.76	59,968,467.44
应收利息	7.4.7.5	8,359,766.61	14,473,823.68
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,710,496,235.19	4,838,979,530.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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		4,849,495.12	4,095,583.60
应付托管费		1,212,373.76	1,023,895.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,803,721.07	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	7.4.7.8	80,000.00	50,000.00
负债合计		8,945,589.95	8,272,229.24
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	5,272,394,417.47	4,673,634,207.85
未分配利润	7.4.7.10	429,156,227.77	157,073,093.46
所有者权益合计		5,701,550,645.24	4,830,707,301.31
负债和所有者权益总计		5,710,496,235.19	4,838,979,530.55

注：1、报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.081 元，基金份额总额 5,272,394,417.47 份。

2、本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，上期财务报表的实际编制期间为 2015 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基 金合同生效日)至 2015年12月31日
一、收入		339,149,962.26	201,054,140.05
1. 利息收入		51,188,029.29	36,337,081.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	32,420,677.10	34,100,994.09
债券利息收入		12,482,297.79	2,236,087.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,285,054.40	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		345,009,537.51	110,653,530.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	271,318,984.97	109,991,160.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,988,642.18	374,370.49
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	12,560,588.00	-
股利收益	7.4.7.16	37,141,322.36	288,000.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-59,273,168.25	52,344,436.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,225,563.71	1,719,091.13
减：二、费用		134,722,118.10	41,736,028.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	103,219,237.92	28,955,143.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	12,211,620.53	6,041,992.44
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	19,061,232.94	6,626,452.32
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	230,026.71	112,440.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		204,427,844.16	159,318,112.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		204,427,844.16	159,318,112.03

注：本基金合同于 2015 年 7 月 1 日生效，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	-	204,427,844.16	204,427,844.16
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）	598,760,209.62	67,655,290.15	666,415,499.77
其中：1. 基金申购款	2,379,478,897.20	106,932,226.56	2,486,411,123.76
2. 基金赎回款	-1,780,718,687.58	-39,276,936.41	-1,819,995,623.99
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)	5,272,394,417.47	429,156,227.77	5,701,550,645.24
项目	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	4,787,173,551.39	-	4,787,173,551.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	159,318,112.03	159,318,112.03
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)	-113,539,343.54	-2,245,018.57	-115,784,362.11
其中:1.基金申购款	543,235,621.96	10,831,916.78	554,067,538.74
2.基金赎回款	-656,774,965.50	-13,076,935.35	-669,851,900.85
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)	4,673,634,207.85	157,073,093.46	4,830,707,301.31

注:本基金合同于2015年7月1日生效,上年度可比期间数据按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

庄园芳

基金管理人负责人

庄园芳

主管会计工作负责人

詹鸿飞

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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),由兴全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全基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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%至95%;权证投资比例为基金资产净值的0至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%。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移

时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

若基金合同生效不满 3 个月则不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。红利再投资方式免收再投资的费用。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《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》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场

上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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[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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015]125号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,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,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (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营业税和企业所得税。
- (c) 自2016年5月1日起,在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点,建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人,纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

券收入免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,269,497,256.20	2,520,449,813.03
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,269,497,256.20	2,520,449,813.03

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,334,875,686.87	3,291,181,484.12	-43,694,202.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	301,743,944.96	313,454,153.40	11,710,208.44
	银行间市场	473,345,737.45	498,401,000.00	25,055,262.55
	合计	775,089,682.41	811,855,153.40	36,765,470.99
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,109,965,369.28	4,103,036,637.52	-6,928,731.76
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,234,742,246.11	1,283,573,195.72	48,830,949.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	287,378,000.00	288,359,858.40	981,858.40
	银行间市场	403,538,371.52	406,070,000.00	2,531,628.48
	合计	690,916,371.52	694,429,858.40	3,513,486.88
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,925,658,617.63	1,978,003,054.12	52,344,436.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	586,017.89	1,199,398.61
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	3,859.20	6,595.00
应收债券利息	7,719,908.09	13,266,161.31
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	48,418.13	1,025.76
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,563.30	643.00
合计	8,359,766.61	14,473,823.68

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,783,743.04	3,101,149.75

银行间市场应付交易费用	19,978.03	1,600.00
合计	2,803,721.07	3,102,749.75

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016年12月31日	2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	80,000.00	50,000.00
-	-	-
合计	80,000.00	50,000.00

7.4.7.9 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12月31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	2,379,478,897.20	2,379,478,897.20
本期赎回(以“-”号填列)	-1,780,718,687.58	-1,780,718,687.58
- 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	5,272,394,417.47	5,272,394,417.47

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	263,701,012.41	-59,273,168.25	204,427,844.16
本期基金份额交易产生的变动数	40,130,573.27	27,524,716.88	67,655,290.15
其中：基金申购款	99,710,918.47	7,221,308.09	106,932,226.56
基金赎回款	-59,580,345.20	20,303,408.79	-39,276,936.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	409,459,973.14	19,696,254.63	429,156,227.77

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
活期存款利息收入	32,182,083.60	34,065,720.16
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	127,333.66	30,449.40
其他	111,259.84	4,824.53
合计	32,420,677.10	34,100,994.09

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
卖出股票成交总额	6,994,557,827.97	2,222,371,226.77
减：卖出股票成本总额	6,723,238,843.00	2,112,380,066.35
买卖股票差价收入	271,318,984.97	109,991,160.42

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合 同生效日)至2015年12月31 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	21,633,669.50	374,370.49
债券投资收益——赎回差价收入	2,354,972.68	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	23,988,642.18	374,370.49

7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合 同生效日)至2015年12月31 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	641,547,241.06	1,129,982.75
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	605,232,396.52	755,000.00
减：应收利息总额	14,681,175.04	612.26
买卖债券差价收入	21,633,669.50	374,370.49

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016 年12月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合 同生效日)至2015年12月31 日
----	---------------------------------	---------------------------------------------------

赎回基金份额对价总额	23,600,000.00	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	20,000,000.00	-
减：赎回债券应收利息总额	1,245,027.32	-
赎回差价收入	2,354,972.68	-

7.4.7.13.4 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期末未投资权证。

7.4.7.15.2 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	上年度可比期间收益金额
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股指期货-投资收益	12,560,588.00	

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	37,141,322.36	288,000.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	37,141,322.36	288,000.00

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同 生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-59,273,168.25	52,344,436.49
——股票投资	-92,525,152.36	48,830,949.61
——债券投资	33,251,984.11	3,513,486.88
——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	-59,273,168.25	52,344,436.49

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效日) 至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,194,215.04	1,665,632.44
转换费收入	31,348.67	10,040.72
其他收入	-	43,417.97
合计	2,225,563.71	1,719,091.13

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	19,055,407.94	6,624,852.32

银行间市场交易费用	5,825.00	1,600.00
合计	19,061,232.94	6,626,452.32

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生 效日)至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	60,000.00
中债登账户维护费用	19,500.00	-
银行手续费	16,126.71	2,040.00
其他费用	600.00	400.00
上清所账户维护费	13,800.00	-
-	-	-
合计	230,026.71	112,440.00

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）	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
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31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	10,928,945,120.17	71.70%	4,069,381,441.35	73.36%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31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	147,304,398.44	92.14%	1,129,370.49	100.00%

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年 12月31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%	-	-

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 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12月31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	8,062,802.12	74.75%	1,516,986.44	54.49%
关联方名称	上年度可比期间 2015年7月1日(基金合同生效日)至2015年12月31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	2,968,491.26	76.09%	2,168,452.57	69.92%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	103,219,237.92	28,955,143.26
其中：支付销售机构的客户维护费	11,823,066.84	7,015,587.53

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，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 1 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	12,211,620.53	6,041,992.44

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，上年度可比期间数据按实际存续期计算。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 7 月 1 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 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	10,000,750.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1897%	0.2140%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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。

7.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期内未持有本基金。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 7 月 1 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 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	1,269,497,256.20	32,182,083.60	2,520,449,813.03	34,065,720.16

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
601801	皖新传媒	2016年9月6日	2017年9月1日	非公开发行流通受限	11.82	13.66	10,998,308	130,000,000.56	150,236,887.28	-
000413	东旭光电	2016年8月25日	2017年8月28日	非公开发行流通受限	6.29	8.02	9,538,951	60,000,001.79	76,502,387.02	-
002594	比亚迪	2016年7月22日	2017年7月25日	非公开发行流通受限	57.40	49.68	1,045,296	59,999,990.40	51,930,305.28	-
000690	宝新能源	2016年4月25日	2017年4月26日	非公开发行流	6.90	8.49	2,898,527	19,999,836.30	24,608,494.23	-

		日	日	通受 限						
600604	市北 高新	2016 年 8 月 31 日	2017 年 8 月 29 日	非公 开发 行流 通受 限	15.31	17.11	914,435	13,999,999.85	15,645,982.85	-
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	19.19	641,700	8,085,420.00	12,314,223.00	-
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	54.60	121,285	2,616,117.45	6,622,161.00	-
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	54.26	77,621	1,780,625.74	4,211,715.46	-
002792	通宇 通讯	2016 年 6 月 7 日	2017 年 3 月 28 日	新股 流通 受限 -转 增	-	54.26	38,810	-	2,105,830.60	-
002821	凯莱 英	2016 年 11 月 11 日	2017 年 11 月 20 日	新股 流通 受限	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-

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	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月20日	新股流通受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新	2016	2017	新股	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-

	交运	2016年12月27日	2017年1月5日	流通受限						
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	新股流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.12.2 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
300184	力源信息	2016年12月28日	重大事项	14.42	2017年1月5日	15.22	4,727,110	82,714,841.41	68,164,926.20	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 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作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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发行的证券，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。

7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	129,437,000.00	100,160,000.00
A-1 以下	-	-

未评级	258,813,000.00	-
合计	388,250,000.00	100,160,000.00

注：此处列示的未评级短期信用债券是超短期融资债券。

7.4.13.2.2 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12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	41,684,902.00	314,450,198.80
AAA 以下	272,640,251.40	159,819,659.60
未评级	96,506,000.00	120,000,000.00
合计	410,831,153.40	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。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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	1,269,497,256.20	-	-	-	-	-	1,269,497,256.20
结算备付金	271,128,480.51	-	-	-	-	-	271,128,480.51
存出保证金	3,473,98	-	-	-	-	-	3,473,98

	8.59						8.59
交易性金融资产	-	-498,979,000.00	162,135,415.00	499,740,738.40	3,342,181,484.12	4,103,036,637.52	
应收证券清算款	-	-	-	-	55,000,105.76	55,000,105.76	
应收利息	-	-	-	-	8,359,766.61	8,359,766.61	
资产总计	1,544,099,725.30	-498,979,000.00	162,135,415.00	499,740,738.40	3,405,541,356.49	5,710,496,235.19	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,849,495.12	4,849,495.12	
应付托管费	-	-	-	-	1,212,373.76	1,212,373.76	
应付交易费用	-	-	-	-	2,803,721.07	2,803,721.07	
其他负债	-	-	-	-	80,000.00	80,000.00	
负债总计	-	-	-	-	8,945,589.95	8,945,589.95	
利率敏感度缺口	1,544,099,725.30	-498,979,000.00	162,135,415.00	499,740,738.40	3,396,595,766.54	5,701,550,645.24	
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	2,520,449,813.03	-	-	-	-	-	2,520,449,813.03
结算备付金	264,655,	-	-	-	-	-	264,655,

	604.26						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	587,085,676.40	17,184,197.00	1,283,573.72	1,978,003.05	1,978,003.05
应收证券清算款	-	-	-	-	59,968,467.44	59,968,467.44	59,968,467.44
应收利息	-	-	-	-	14,473,823.68	14,473,823.68	14,473,823.68
资产总计	2,786,534.18	-100,160,000.00	587,085,676.40	17,184,197.00	1,358,015.48	4,838,979.55	4,838,979.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,095,583.60	4,095,583.60	4,095,583.60
应付托管费	-	-	-	-	1,023,895.89	1,023,895.89	1,023,895.89
应付交易费用	-	-	-	-	3,102,749.75	3,102,749.75	3,102,749.75
其他负债	-	-	-	-	50,000.00	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	-	8,272,229.24	8,272,229.24	8,272,229.24
利率敏感度缺口	2,786,534.18	-100,160,000.00	587,085,676.40	17,184,197.00	1,349,743.25	4,830,707.31	4,830,707.31

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2015年12月31日）

			日)
	利率+1%	-4,239,060.61	-3,529,662.11
	利率-1%	4,470,809.92	3,598,074.31

注：1. 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，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31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	3,291,181,484.12	57.72	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	811,855,153.40	14.24	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	4,103,036,637.52	71.96	1,978,003,054.12	40.95

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准 中的股票指数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12月 31日）	上年度末（2015年12月 31日）
	业绩比较基准-10%	-273,925,893.38	-139,182,278.50
	业绩比较基准+10%	273,925,893.38	139,182,278.50

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。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下面列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 2,944,002,306.68 元，第二层次的余额为 1,108,034,330.84 元，第三层次的余额为 51,000,000.00 (2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,033,558,978.95 元，第二层次的余额为 944,444,075.17 元，无属于第三层次的余额)。

2016 年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2016 年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2015 年 12 月 31 日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,291,181,484.12	57.63
	其中：股票	3,291,181,484.12	57.63
2	固定收益投资	811,855,153.40	14.22
	其中：债券	811,855,153.40	14.22
	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	1,540,625,736.71	26.98
7	其他各项资产	66,833,860.96	1.17
8	合计	5,710,496,235.19	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,892,881,876.95	33.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,608,494.23	0.43
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	68,164,926.20	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	170,170,572.87	2.98
J	金融业	97,960,988.44	1.72
K	房地产业	254,706,921.90	4.47
L	租赁和商务服务业	85,525,000.00	1.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	62,548,582.20	1.10
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	634,589,070.42	11.13
S	综合	-	-

	合计	3,291,181,484.12	57.72
--	----	------------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

8.3 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	300144	宋城演艺	18,500,000	387,390,000.00	6.79
2	600584	长电科技	13,146,733	232,039,837.45	4.07
3	000157	中联重科	48,817,126	221,629,752.04	3.89
4	601100	恒立液压	13,779,561	221,299,749.66	3.88
5	000425	徐工机械	61,925,147	209,306,996.86	3.67
6	600398	海澜之家	17,375,343	187,479,950.97	3.29
7	600048	保利地产	19,875,265	181,461,169.45	3.18
8	601801	皖新传媒	11,477,110	158,649,438.42	2.78
9	600882	广泽股份	13,684,113	146,967,373.62	2.58
10	600060	海信电器	7,542,827	129,133,198.24	2.26
11	601600	中国铝业	30,000,000	126,600,000.00	2.22
12	300343	联创互联	4,365,500	104,335,450.00	1.83
13	601997	贵阳银行	6,048,574	95,446,497.72	1.67
14	000403	ST 生化	2,828,940	92,817,521.40	1.63
15	300291	华录百纳	3,974,400	88,549,632.00	1.55
16	002707	众信旅游	5,500,000	85,525,000.00	1.50
17	000413	东旭光电	9,538,951	76,502,387.02	1.34
18	300184	力源信息	4,727,110	68,164,926.20	1.20
19	300017	网宿科技	1,200,000	64,332,000.00	1.13
20	000069	华侨城 A	8,999,796	62,548,582.20	1.10
21	600325	华发股份	4,499,982	57,599,769.60	1.01

22	002594	比亚迪	1,045,296	51,930,305.28	0.91
23	600062	华润双鹤	2,160,102	48,019,067.46	0.84
24	600389	江山股份	2,219,158	43,806,178.92	0.77
25	002422	科伦药业	2,049,691	33,041,018.92	0.58
26	000690	宝新能源	2,898,527	24,608,494.23	0.43
27	000661	长春高新	211,594	23,666,788.90	0.42
28	300083	劲胜精密	2,513,764	18,476,165.40	0.32
29	600604	市北高新	914,435	15,645,982.85	0.27
30	002590	万安科技	641,700	12,314,223.00	0.22
31	002791	坚朗五金	121,285	6,622,161.00	0.12
32	002792	通宇通讯	116,431	6,317,546.06	0.11
33	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	0.05
34	601229	上海银行	103,424	2,407,710.72	0.04
35	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.02
36	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.02
37	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.00
38	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
39	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
40	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
41	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
42	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
43	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
44	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
45	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
46	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
47	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
48	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
49	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00

50	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
51	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
52	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
53	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
54	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
55	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
56	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
57	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	1,809,210,934.08	37.45
2	300144	宋城演艺	418,100,000.00	8.66
3	600297	广汇汽车	417,560,000.00	8.64
4	300413	快乐购	359,636,071.95	7.44
5	601801	皖新传媒	238,737,321.97	4.94
6	000157	中联重科	227,665,037.32	4.71
7	000425	徐工机械	211,794,034.60	4.38
8	601100	恒立液压	211,244,757.89	4.37
9	600886	国投电力	203,141,485.58	4.21
10	600048	保利地产	194,783,798.09	4.03
11	000671	阳光城	189,000,000.00	3.91
12	600584	长电科技	187,297,252.06	3.88
13	300431	暴风集团	177,180,000.00	3.67
14	600882	广泽股份	174,341,926.80	3.61
15	002766	索菱股份	156,380,000.00	3.24

16	000625	长安汽车	150,602,423.95	3.12
17	600572	康恩贝	143,816,513.60	2.98
18	601600	中国铝业	135,171,973.48	2.80
19	600765	中航重机	134,320,000.00	2.78
20	600060	海信电器	132,576,817.25	2.74
21	600666	奥瑞德	128,000,000.00	2.65
22	600104	上汽集团	123,500,400.00	2.56
23	600398	海澜之家	119,814,833.69	2.48
24	300343	联创互联	116,055,000.00	2.40
25	603005	晶方科技	111,800,000.00	2.31
26	000895	双汇发展	103,695,901.33	2.15
27	000630	铜陵有色	100,569,697.60	2.08
28	002707	众信旅游	100,265,000.00	2.08
29	601997	贵阳银行	100,208,031.80	2.07

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。

8.4.2 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	1,898,815,378.10	39.31
2	600297	广汇汽车	443,587,771.83	9.18
3	300413	快乐购	378,218,266.51	7.83
4	600886	国投电力	312,108,985.76	6.46
5	000625	长安汽车	284,372,188.23	5.89
6	000671	阳光城	204,588,441.44	4.24
7	002766	索菱股份	173,258,565.74	3.59
8	300431	暴风集团	171,059,290.71	3.54
9	000662	天夏智慧	149,273,607.97	3.09

10	600572	康恩贝	148,715,505.67	3.08
11	002508	老板电器	134,527,788.56	2.78
12	601801	皖新传媒	131,610,746.98	2.72
13	000630	铜陵有色	130,127,164.06	2.69
14	603005	晶方科技	127,840,593.47	2.65
15	600765	中航重机	126,460,136.36	2.62
16	000895	双汇发展	125,705,405.25	2.60
17	600104	上汽集团	125,237,527.33	2.59
18	600666	奥瑞德	122,451,282.64	2.53
19	601311	骆驼股份	93,645,792.82	1.94
20	601100	恒立液压	86,597,713.74	1.79

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。

8.4.3 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	8,823,372,283.76
卖出股票收入（成交）总额	6,994,557,827.97

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。

8.5 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	28,851,000.00	0.51
	其中：政策性金融债	28,851,000.00	0.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	388,250,000.00	6.81
6	中期票据	81,300,000.00	1.43
7	可转债（可交换债）	313,454,153.40	5.50

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	811,855,153.40	14.24

8.6 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	132006	16 皖新 EB	724,960	82,609,192.00	1.45
2	041653052	16 华能 CP001	800,000	79,512,000.00	1.39
3	110032	三一转债	641,420	70,889,738.40	1.24
4	011609008	16 国电集 SCP008	600,000	59,724,000.00	1.05
5	011698603	16 国电集 SCP007	600,000	59,658,000.00	1.05

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.1 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	3,473,988.59
2	应收证券清算款	55,000,105.76
3	应收股利	-
4	应收利息	8,359,766.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66,833,860.96

8.12.4 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	110032	三一转债	70,889,738.40	1.24
2	117009	15 九洲债	40,676,000.00	0.71
3	137001	15 美克 EB	16,077,000.00	0.28
4	117014	15 大族 01	11,388,321.00	0.20

5	132004	15 国盛 EB	9,445,732.00	0.17
6	132005	15 国资 EB	1,939,170.00	0.03

8.12.5 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	601801	皖新传媒	150,236,887.28	2.64	非公开发行

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
37,026	142,397.08	2,342,285,931.85	44.43%	2,930,108,485.62	55.57%

9.2 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	9,435,309.82	0.1790%

9.3 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：本基金的基金经理之一也是本公司投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

9.4 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	0.19	10,000,750.00	0.19	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	4,999,525.00	0.09	4,999,525.00	0.09	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	15,000,275.00	0.28	15,000,275.00	0.28	3年

§ 10 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	2,379,478,897.20
减:本报告期基金总赎回份额	1,780,718,687.58
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	5,272,394,417.47

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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) 报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

2016 年 1 月 13 日起，郑文惠女士担任基金管理人副总经理。

2016 年 5 月 9 日起，基金管理人的法定代表人、董事长由兰荣变更为庄园芳。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2015 年 7 月 1 日）起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 8 万元人民币。

11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
兴业证券	2	10,928,945,120.17	71.70%	8,062,802.12	74.75%	-
华泰证券	2	1,517,724,531.42	9.96%	958,135.20	8.88%	-
长江证券	1	1,226,152,053.68	8.04%	774,073.54	7.18%	-
光大证券	1	919,548,111.47	6.03%	580,511.66	5.38%	-
浙商证券	1	650,993,848.75	4.27%	410,971.41	3.81%	-

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。

11.7.2 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	147,304,398.44	92.14%	1,437,800,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	2,188,573.02	1.37%	-	-	-	-
长江证券	1,072,542.45	0.67%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	9,310,396.92	5.82%	-	-	-	-

本基金本报告期租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

11.8 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、公司网站	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	中国证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日

	关业务办理时间的公告		
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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	2016 年 1 月 13 日
9	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	2016 年 4 月 21 日
27	关于长期停牌股票（鼎龙股份）	中国证券报、公司网站	2016 年 4 月 22 日

	估值方法调整的公告	站	
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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	2016年5月9日
33	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	2016年5月17日
37	关于旗下部分基金投资通裕重工（300185）非公开发行股票的公告	中国证券报、公司网站	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、公司网站	2016年6月15日
39	关于调整开放式基金开户证件类型的公告	中国证券报、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	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、公司网站	2016 年 6 月 28 日
45	旗下各基金 2016 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
46	关于调整“通联支付”部分银行卡网上直销申购费率的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 5 日
47	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 3 次)	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 11 日
48	关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 15 日
49	关于在工商银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 18 日
50	关于增加南京证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 20 日
51	关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 23 日
52	关于增加北京广源达信投资管理	中国证券报、公司网站	2016 年 7 月 23 日

	有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	站	
53	关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年7月26日
54	关于旗下部分基金投资比亚迪（002594）非公开发行股票的公告	中国证券报、公司网站	2016年7月26日
55	关于增加中信期货有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年7月26日
56	关于兴全新视野定期开放混合型发起式证券投资基金开放期提示性公告	中国证券报、公司网站	2016年7月26日
57	关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年7月29日
58	关于增加北京肯特瑞财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年8月4日
59	关于旗下基金参加中信证券线上交易平台“信e投”基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	2016年8月11日
60	关于长期停牌股票（西藏城投）估值方法调整的公告	中国证券报、公司网站	2016年8月16日
61	关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年8月19日
62	关于调整旗下基金在兴业银行股份有限公司申购及定期定额申购	中国证券报、公司网站	2016年8月25日

	起点金额的公告		
63	关于旗下部分基金投资东旭光电（000413）非公开发行股票的公告	中国证券报、公司网站	2016年8月27日
64	关于旗下部分基金投资市北高新（600604）非公开发行股票的公告	中国证券报、公司网站	2016年9月2日
65	关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年9月2日
66	关于旗下部分基金投资皖新传媒（601801）非公开发行股票的公告	中国证券报、公司网站	2016年9月8日
67	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率率的公告	中国证券报、公司网站	2016年9月20日
68	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4次）	中国证券报、公司网站	2016年10月11日
69	关于增加上海华信证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年10月15日
70	关于增加珠海盈米为兴全新视野基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年10月21日
71	关于旗下部分基金投资力源信息（300184）非公开发行股票的公告	中国证券报、公司网站	2016年10月27日
72	关于旗下部分基金参加中信证券	中国证券报、公司网站	2016年11月2日

	(山东)基金申购费率优惠活动的公告	站	
73	关于增加华西证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、公司网站	2016年11月17日
74	关于办公地址变更的公告	中国证券报、公司网站	2016年11月21日
75	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	中国证券报、公司网站	2016年11月22日
76	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	中国证券报、公司网站	2016年11月29日
77	关于调整旗下部分基金最低申购、追加申购、定期定额投资金额、及最低赎回、转换转出、持有份额限制的公告	中国证券报、公司网站	2016年12月12日
78	关于长期停牌股票(徐工机械)估值方法调整的公告	中国证券报、公司网站	2016年12月14日
79	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、公司网站	2016年12月22日
80	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	中国证券报、公司网站	2016年12月22日
81	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、公司网站	2016年12月29日
82	关于旗下基金在中国农业银行关于开放式基金交易费率优惠的公告	中国证券报、公司网站	2016年12月30日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）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

兴全基金管理有限公司

2017年3月31日