

# 兴全有机增长灵活配置混合型 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

<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.....	5
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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	14

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 .....	14
<b>§5 托管人报告.....</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
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
<b>§6 审计报告.....</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
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 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
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 .....	59
8.12 投资组合报告附注.....	59
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
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
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
11.4 基金投资策略的改变.....	61
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.....	64
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>70</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>70</b>
13.1 备查文件目录.....	70
13.2 存放地点.....	70
13.3 查阅方式.....	70

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴全有机增长混合
场内简称	-
基金主代码	340008
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 日
基金管理人	兴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	1,300,148,042.73 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于有机增长能力强的公司，获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方法，定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。并借鉴海外有机增长的研究成果，构建“兴全有机增长筛选系统”，将有机增长投资作为本基金股票组合投资的经营理念。
业绩比较基准	沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款

	利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型证券投资基金，高于可转债、债券型、货币型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的证券投资基金品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴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、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
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	德勤华永会计师事务所（特殊普通	上海市延安东路222号30楼

	合伙)	
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	2014 年
本期已实现收益	72,423,450.10	719,127,396.20	263,162,568.87
本期利润	37,163,523.64	646,507,953.25	291,206,882.63
加权平均基金份额本期利润	0.0391	1.2695	0.2214
本期加权平均净值利润率	1.87%	53.15%	13.81%
本期基金份额净值增长率	0.30%	59.13%	33.39%
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	1,184,676,797.08	646,131,863.06	382,428,893.03
期末可供分配基金份额利润	0.9112	1.6632	0.4618
期末基金资产净值	2,484,824,839.81	1,072,532,176.98	1,436,717,092.95
期末基金份额净值	1.9112	2.7608	1.7349
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	176.90%	176.08%	73.49%

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：开放式基金的申购费

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	-7.38%	0.85%	0.17%	0.39%	-7.55%	0.46%
过去六个月	-0.24%	0.91%	2.84%	0.40%	-3.08%	0.51%
过去一年	0.30%	1.17%	-4.12%	0.71%	4.42%	0.46%
过去三年	112.90%	1.52%	29.94%	0.88%	82.96%	0.64%
过去五年	158.67%	1.48%	34.82%	0.80%	123.85%	0.68%
自基金合同生效起至今	176.90%	1.36%	40.45%	0.80%	136.45%	0.56%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本基金采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债市场（包括银行间、上交所、深交所）的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{中证国债指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

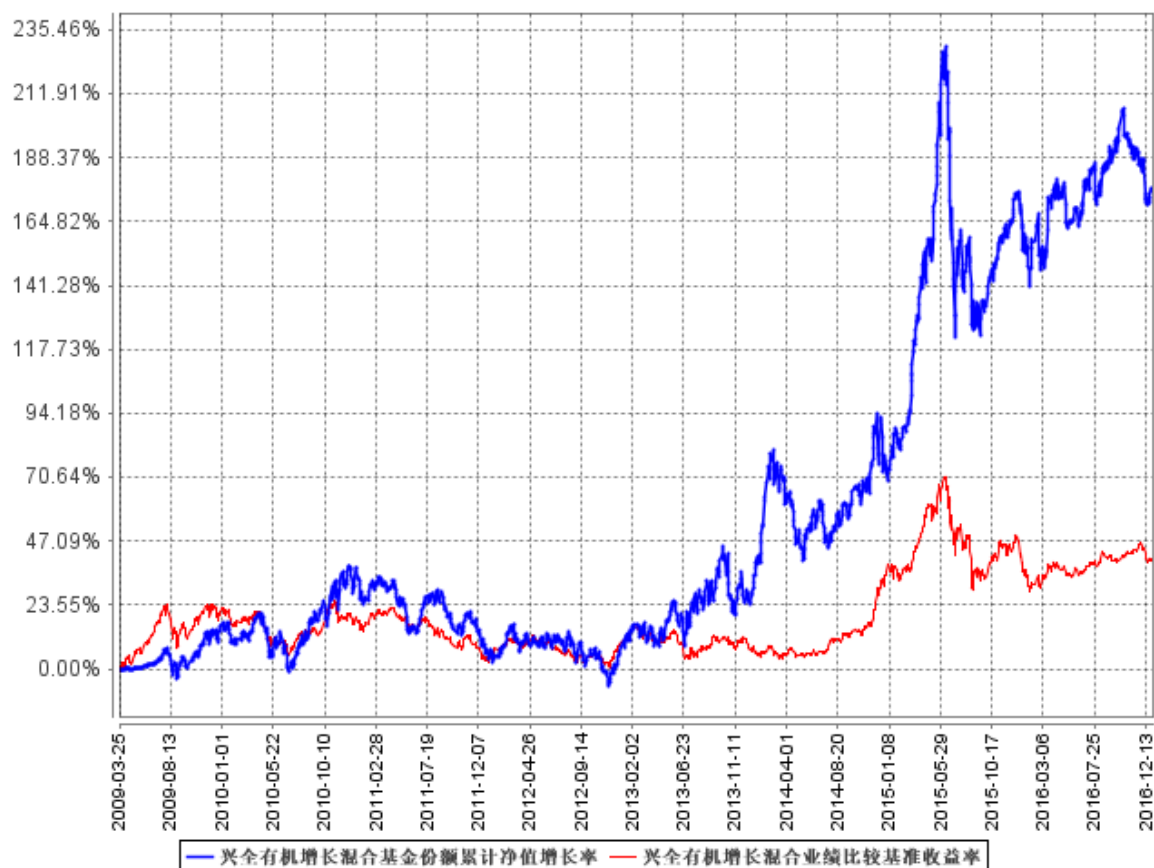
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

2、自 2015 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%”变更为“沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%”。

### 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

兴全有机增长混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



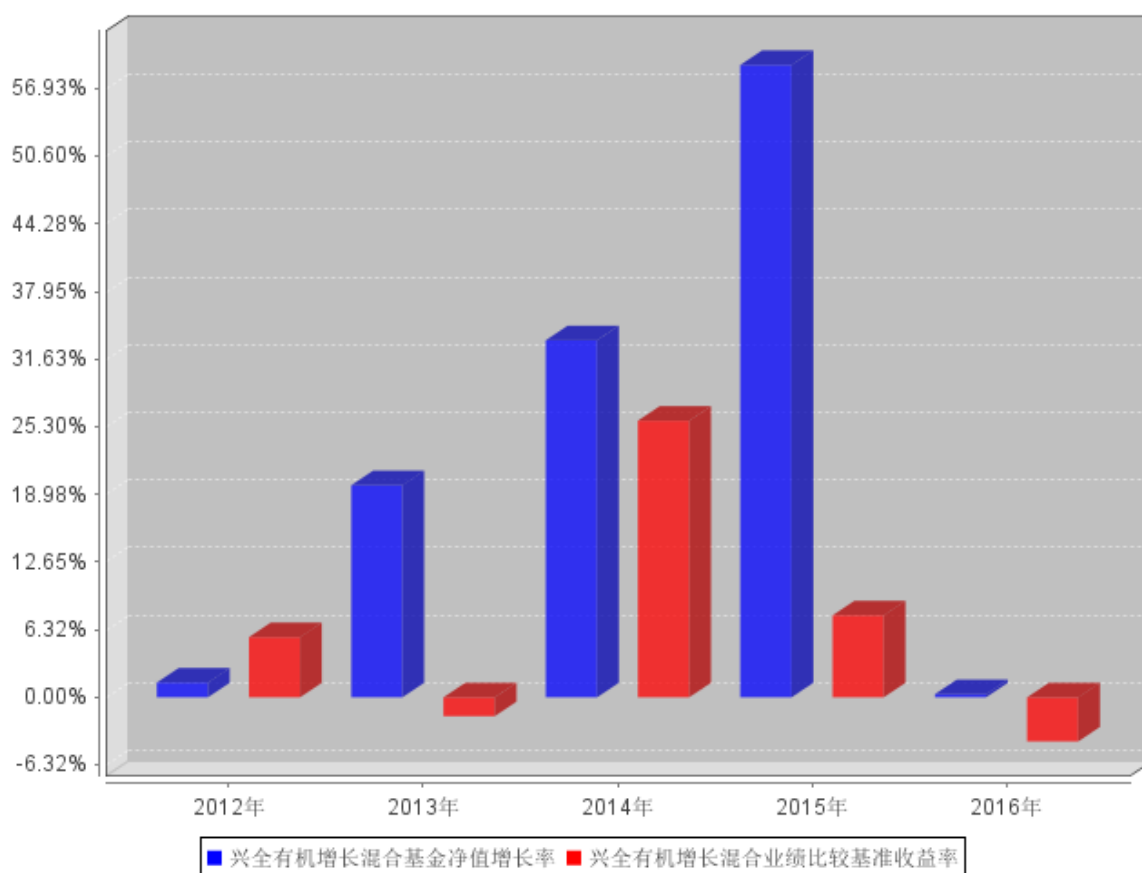
注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2009 年 3 月 25 日至 2009 年 9 月 25 日，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。



### 3.2.3 过去五年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

兴全有机增长混合过去五年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：自 2015 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%”变更为“沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%”。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年 度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合计	备注
2016	8.200	3,353,518,051.23	131,330,279.00	3,484,848,330.23	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	8.200	3,353,518,051.23	131,330,279.00	3,484,848,330.23	

## § 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		
季侃乐	本基金基金经理	2015年12月31日	-	7年	管理学硕士，历任兴全基金管理有限公司行业研究员、兴全社会责任股票型证券投资基金基

					金经理助理、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、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年初由于人民币汇率的突发波动影响，制约了国内货币政策的空间，叠加熔断制度的实施，造成市场短期大幅调整。由于从 2014 年下半年以来的行情缺乏经济基本面的支持，股价的核心影响因素即为流动性，而市场对宽松的流动性产生边际的变化，因此随后一段时间内市场面临了整体估值收缩的局面，尤其以创业板为代表性的高估值小市值股票。另一方面市场多年未多加关注的强周期性行业随着国家供给侧改革的强力实施其基本面发生了较为明显的变化，连同以消费为代表性的白马和以一带一路为代表性的蓝筹建筑工程构成了市场关注的几条投资主线，也逐渐实现了中期的持续的风格切换。

本基金期初仓位水平较低，一定程度抵御了市场下跌的风险；随后在一季度末随着市场系统性风险的解除逐步增加了仓位，贯彻以成长为选股标准，以价值为交易依据的投资风格与操作思路取得了一定的成效。

#### 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 0.30%，同期业绩比较基准收益率-4.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，宏观经济从 GDP 来看可能仍然处于小幅下滑的状态，但在供给侧改革的持续强力推进、国家基建投资的持续增长与房地产企业补库存需求的推动下经济增长的稳定性已变得越来越明确，使得股市有了久违的基本面支撑；而养老金的入市与沪港通深港通的日益活跃也使 A 股有了局部的增量资金，这些增量资金将显著有益于去年二季度以来的价值投资风格的继续强化。

因此根据上述判断，管理人在 2017 年将继续贯彻以成长为选股标准，以价值为交易依据的投资风格，更加严格的标准去选择个股以控制下行风险，重点通过公司业绩的长期增长来获得投资回报，充分利用混合基金仓位的灵活性优势，根据股票对价值的反映情况适时进行仓位的调整，重点挖掘有中长期价值的个股进行投资。

#### 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》、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金实施了 1 次利润分配，分配金额 3,484,848,330.23 元，符合本基金基金合同的规定。

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

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

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；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	德师报(审)字(17)第 P00872 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	兴全有机增长灵活配置混合型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有机增长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“兴全有机增长”)的财务报表,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有机增长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)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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而导致的重大错报。
注册会计师的责任段	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。 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

	<p>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	<p>我们认为，兴全有机增长的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全有机增长 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>	
注册会计师的姓名	许湘照	汪芳
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国 上海	
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：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	61,754,627.64	602,292,356.25



结算备付金		3,690,473.51	502,867.50
存出保证金		1,866,541.92	760,722.81
交易性金融资产	7.4.7.2	2,123,048,400.35	416,599,703.50
其中：股票投资		1,986,699,674.15	375,803,873.50
基金投资		-	-
债券投资		136,348,726.20	40,795,830.00
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		313,271,516.50	51,101,632.87
应收利息	7.4.7.5	1,278,605.04	2,526,222.66
应收股利		-	-
应收申购款		2,332,938.72	1,704,523.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,507,243,103.68	1,075,488,029.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		13,789,084.81	-
应付赎回款		2,458,226.07	599,807.66
应付管理人报酬		3,206,550.62	1,329,780.93
应付托管费		534,425.12	221,630.17
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	2,398,450.38	345,549.74
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	31,526.87	459,083.87
负债合计		22,418,263.87	2,955,852.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,300,148,042.73	388,482,212.54
未分配利润	7.4.7.10	1,184,676,797.08	684,049,964.44
所有者权益合计		2,484,824,839.81	1,072,532,176.98
负债和所有者权益总计		2,507,243,103.68	1,075,488,029.35

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9112 元，基金份额总额 1,300,148,042.73 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		92,518,540.86	678,129,464.99
1. 利息收入		12,793,931.85	8,893,592.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,150,062.88	6,501,100.14
债券利息收入		570,332.51	2,377,024.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,073,536.46	15,466.93
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		106,200,210.78	740,384,505.75

其中：股票投资收益	7.4.7.12	103,158,187.09	698,314,795.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,015,895.25	39,259,669.65
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	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,057,918.94	2,810,040.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-35,259,926.46	-72,619,442.95
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	8,784,324.69	1,470,810.18
<b>减：二、费用</b>		55,355,017.22	31,621,511.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	29,427,372.94	18,202,849.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,904,562.20	3,033,808.30
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	20,725,895.43	10,095,886.32
5. 利息支出		-	11,336.67
其中：卖出回购金融资产支出		-	11,336.67
6. 其他费用	7.4.7.20	297,186.65	277,630.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		37,163,523.64	646,507,953.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		37,163,523.64	646,507,953.25

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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）	388,482,212.54	684,049,964.44	1,072,532,176.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,163,523.64	37,163,523.64
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）	911,665,830.19	3,948,311,639.23	4,859,977,469.42
其中：1. 基金申购款	4,632,315,102.59	7,173,932,338.69	11,806,247,441.28
2. 基金赎回款	-3,720,649,272.40	-3,225,620,699.46	-6,946,269,971.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-3,484,848,330.23	-3,484,848,330.23
五、期末所有者权益（基金净值）	1,300,148,042.73	1,184,676,797.08	2,484,824,839.81
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 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）	828,109,260.78	608,607,832.17	1,436,717,092.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	646,507,953.25	646,507,953.25

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)	-439,627,048.24	-571,065,820.98	-1,010,692,869.22
其中：1. 基金申购款	337,917,716.75	425,863,138.43	763,780,855.18
2. 基金赎回款	-777,544,764.99	-996,928,959.41	-1,774,473,724.40
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)	388,482,212.54	684,049,964.44	1,072,532,176.98

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：

<u>          庄园芳          </u>	<u>          庄园芳          </u>	<u>          詹鸿飞          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金(原名兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金)(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1395号文《关于核准兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于2009年3月25日正式生效,首次设立募集规模为1,980,254,871.35份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴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。本基金于2011年1月1日起更名为兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金,股票投资比例为基金资

产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：自 2015 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%”变更为“沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%”。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 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

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具。

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法确认债券投资成本。

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

### (3) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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;第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下:

##### 1) 股票投资

###### (1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的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,按最近交易日的收盘价估值;如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的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值,调整最近交易市价,确定公允价值。

###### (2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

B. 首次公开发行的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按其成本价计算。

首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值。

###### C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时,采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值。

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时,按中国证监会相关规定处理。



## 2) 债券投资

银行间市场交易的固定收益品种按照第三方估值机构提供估值确定公允价值；交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)按照第三方估值机构提供估值确定公允价值。

对于交易所市场上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价。

未上市债券、交易所上市交易的资产支持证券及私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下或相关利率没有发生大的变动的情况下，按成本进行后续计量。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提。

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

(8) 股利收益于除息日确认，并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后的净额入账。

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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。

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提。

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利

按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额；

(3) 本基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(6) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7) 基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(8) 法律法规或中国证监会另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股

息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

2) 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、债券免征营业税和增值税。

3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 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	61,754,627.64	602,292,356.25
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	61,754,627.64	602,292,356.25

## 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		1,933,669,488.48	1,986,699,674.15	53,030,185.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	136,508,703.30	136,348,726.20	-159,977.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	136,508,703.30	136,348,726.20	-159,977.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,070,178,191.78	2,123,048,400.35	52,870,208.57
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		286,711,074.06	375,803,873.50	89,092,799.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	41,758,494.41	40,795,830.00	-962,664.41
	银行间市场	-	-	-
	合计	41,758,494.41	40,795,830.00	-962,664.41
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		328,469,568.47	416,599,703.50	88,130,135.03

### 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均未持有衍生金融资产/负债。

#### 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	105,624.45	273,682.45
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	1,660.80	226.30
应收债券利息	1,151,815.61	2,251,616.88
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	18,664.28	354.73
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	839.90	342.30
合计	1,278,605.04	2,526,222.66

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

### 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	2,393,977.27	345,549.74
银行间市场应付交易费用	4,473.11	-
合计	2,398,450.38	345,549.74

#### 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	7,526.87	1,215.68
预提审计费	24,000.00	48,000.00
预提信息披露费	-	200,000.00
其他	-	209,868.19
合计	31,526.87	459,083.87

#### 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	388,482,212.54	388,482,212.54
本期申购	4,632,315,102.59	4,632,315,102.59
本期赎回（以“-”号填列）	-3,720,649,272.40	-3,720,649,272.40
- 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	1,300,148,042.73	1,300,148,042.73

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	646,131,863.06	37,918,101.38	684,049,964.44
本期利润	72,423,450.10	-35,259,926.46	37,163,523.64
本期基金份额交易产生的变动数	4,042,088,435.69	-93,776,796.46	3,948,311,639.23
其中：基金申购款	7,645,340,119.83	-471,407,781.14	7,173,932,338.69
基金赎回款	-3,603,251,684.14	377,630,984.68	-3,225,620,699.46
本期已分配利润	-3,484,848,330.23	-	-3,484,848,330.23
本期末	1,275,795,418.62	-91,118,621.54	1,184,676,797.08

**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1月1日至2015年12月31日
活期存款利息收入	10,735,543.69	6,428,555.32
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	116,292.08	42,050.11
其他	298,227.11	30,494.71
合计	11,150,062.88	6,501,100.14

**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1月1日至2015年12月31日



卖出股票成交总额	7,066,964,184.38	4,073,771,217.90
减：卖出股票成本总额	6,963,805,997.29	3,375,456,422.68
买卖股票差价收入	103,158,187.09	698,314,795.22

### 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1月1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	-1,015,895.25	39,259,669.65
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	-1,015,895.25	39,259,669.65

#### 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1月1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	43,007,064.18	275,421,403.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,758,494.41	235,044,145.69
减：应收利息总额	2,264,465.02	1,117,588.51
买卖债券差价收入	-1,015,895.25	39,259,669.65

**7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间均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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具。

**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1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,057,918.94	2,810,040.88
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,057,918.94	2,810,040.88

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-35,259,926.46	-72,619,442.95
——股票投资	-36,062,613.77	-35,289,095.84
——债券投资	802,687.31	-37,330,347.11
——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	-35,259,926.46	-72,619,442.95
----	----------------	----------------

#### 7.4.7.18 其他收入

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1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	8,443,905.07	1,204,650.21
转换费收入	130,551.43	254,260.11
其他	209,868.19	11,899.86
合计	8,784,324.69	1,470,810.18

#### 7.4.7.19 交易费用

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1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	20,725,895.43	10,095,886.32
银行间市场交易费用	-	-
合计	20,725,895.43	10,095,886.32

#### 7.4.7.20 其他费用

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1月1日至2015年12月31日
审计费用	48,000.00	48,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
账户维护费用	45,900.00	27,200.00

银行费用	3,286.65	2,230.50
其他	-	200.00
合计	297,186.65	277,630.50

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露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

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股票交易。

### 7.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	29,427,372.94	18,202,849.95
其中：支付销售机构的客户维护费	3,205,829.92	3,660,962.89

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

### 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1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,904,562.20	3,033,808.30

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

**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。

**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1月1日至2015年12月31日
期初持有的基金份额	4,151,718.98	-
期间申购/买入总份额	-	4,151,718.98
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	4,151,718.98	4,151,718.98
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3193%	1.0687%

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**

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投资本基金。

**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1月1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	61,754,627.64	10,735,543.69	602,292,356.25	6,428,555.32

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2016 年 5 月 25 日	-	2016 年 5 月 25 日	8.2003	3,353,518,051.23	131,330,279.00	3,484,848,330.23	
合 计	-	-		8.2003	3,353,518,051.23	131,330,279.00	3,484,848,330.23	

#### 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
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	522,648	29,999,995.20	25,965,152.64	-
002821	凯莱 英	2016 年 11 月	2017 年 11	新股 流通	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-

		11 日	月 20 日	受限						
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	-
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	德新交运	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	新股 流通 受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-



			日							
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	-

上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

#### 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
603986	兆易创新	2016年9月19日	筹划重大事项	177.97	2017年3月13日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-

#### 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。

##### 7.4.12.3.2 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。

#### 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。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、

相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

#### 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

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

##### 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	61,754,627.64	-	-	-	-	-	61,754,627.64
结算备付金	3,690,473.51	-	-	-	-	-	3,690,473.51
存出保证金	1,866,541.92	-	-	-	-	-	1,866,541.92
交易性金融资产	-	-	129,519,132.60	6,829,593.60	-	1,986,699,674.15	2,123,048,400.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	313,271,516.50	313,271,516.50
应收利息	-	-	-	-	-	1,278,605.04	1,278,605.04
应收申购款	14,797.86	-	-	-	-	2,318,140.86	2,332,938.72
资产总计	67,326,440.93	-	129,519,132.60	6,829,593.60	-	2,303,567,936.55	2,507,243,103.68
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,789,084.81	13,789,084.81
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,458,226.07	2,458,226.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,206,550.62	3,206,550.62
应付托管费	-	-	-	-	-	534,425.12	534,425.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,398,450.38	2,398,450.38
其他负债	-	-	-	-	-	31,526.87	31,526.87
负债总计	-	-	-	-	-	22,418,263.87	22,418,263.87
利率敏感度缺口	67,326,440.93	-	129,519,132.60	6,829,593.60	-	-2,281,149,672.68	2,484,824,839.81
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	602,292,356.25	-	-	-	-	-	602,292,356.25
结算备付金	502,867.50	-	-	-	-	-	502,867.50

存出保证金	760,722.81	-	-	-	-	760,722.81	
交易性金融资产	39,003,900.00	-	-	1,791,930.00	-	375,803,873.50	416,599,703.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-	51,101,632.87	51,101,632.87
应收利息	-	-	-	-	-	2,526,222.66	2,526,222.66
应收申购款	1,040,100.12	-	-	-	-	664,423.64	1,704,523.76
资产总计	643,599,946.68	-	-	1,791,930.00	-	430,096,152.67	1,075,488,029.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	599,807.66	599,807.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,329,780.93	1,329,780.93
应付托管费	-	-	-	-	-	221,630.17	221,630.17
应付交易费用	-	-	-	-	-	345,549.74	345,549.74
其他负债	-	-	-	-	-	459,083.87	459,083.87
负债总计	-	-	-	-	-	2,955,852.37	2,955,852.37
利率敏感度缺口	643,599,946.68	-	-	1,791,930.00	-	427,140,300.30	1,072,532,176.98

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	利率 +1%	-750,181.29	-3,198.12
	利率 -1%	758,975.64	3,198.51

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 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	1,986,699,674.15	79.95	375,803,873.50	35.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	136,348,726.20	5.49	40,795,830.00	3.80
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	2,123,048,400.35	85.44	416,599,703.50	38.84

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动
----	---

	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准-10%	-208,960,848.86	-66,768,377.58
	业绩比较基准+10%	208,960,848.86	66,768,377.58

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

#### 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

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债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接近。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

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 1,959,082,509.35 元，第二层次的余额为 163,965,891.00 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 210,492,114.43 元，第二层次的余额为 206,107,589.07 元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和

债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	1,986,699,674.15	79.24
	其中:股票	1,986,699,674.15	79.24
2	固定收益投资	136,348,726.20	5.44
	其中:债券	136,348,726.20	5.44
	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	65,445,101.15	2.61
7	其他各项资产	318,749,602.18	12.71
8	合计	2,507,243,103.68	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	72,853,457.07	2.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,661,453,877.50	66.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,156,799.65	0.69
F	批发和零售业	140,396,041.23	5.65
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	87,335,855.02	3.51
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	7,387,405.00	0.30
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	-	-
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	1,986,699,674.15	79.95

### 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	300136	信维通信	8,690,123	247,668,505.50	9.97
2	002456	欧菲光	7,151,817	245,164,286.76	9.87
3	002475	立讯精密	10,197,623	211,600,677.25	8.52
4	300115	长盈精密	7,937,970	206,863,498.20	8.33
5	002236	大华股份	12,881,122	176,213,748.96	7.09
6	300306	远方光电	7,112,952	168,221,314.80	6.77
7	002241	歌尔股份	6,312,303	167,402,275.56	6.74
8	300124	汇川技术	5,251,670	106,766,451.10	4.30
9	000971	高升控股	3,629,291	85,832,732.15	3.45
10	600827	百联股份	4,666,218	67,006,890.48	2.70
11	002024	苏宁云商	5,005,095	57,308,337.75	2.31
12	000998	隆平高科	1,843,129	39,498,254.47	1.59
13	300373	扬杰科技	1,709,730	33,647,486.40	1.35
14	600598	北大荒	2,734,033	33,355,202.60	1.34
15	600309	万华化学	1,416,776	30,503,187.28	1.23
16	002594	比亚迪	522,648	25,965,152.64	1.04
17	300433	蓝思科技	709,984	19,602,658.24	0.79
18	002507	涪陵榨菜	922,509	12,343,170.42	0.50
19	002419	天虹商场	576,600	8,660,532.00	0.35
20	600729	重庆百货	316,700	7,420,281.00	0.30
21	000882	华联股份	1,616,500	7,387,405.00	0.30
22	000928	中钢国际	327,414	5,739,567.42	0.23
23	600068	葛洲坝	623,600	5,730,884.00	0.23
24	000425	徐工机械	1,684,657	5,694,140.66	0.23

25	600491	龙元建设	491,400	5,670,756.00	0.23
26	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	0.12
27	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.05
28	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
29	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.01
30	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
31	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
32	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
33	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
34	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
35	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
36	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
37	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
38	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
39	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
40	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
41	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
42	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
43	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
44	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
45	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
46	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
47	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	300136	信维通信	425,624,712.84	39.68
2	002475	立讯精密	364,345,332.62	33.97
3	002456	欧菲光	350,056,960.44	32.64
4	002236	大华股份	282,399,771.36	26.33
5	002131	利欧股份	271,393,693.02	25.30
6	002241	歌尔股份	265,520,448.71	24.76
7	300115	长盈精密	248,199,858.80	23.14
8	000971	高升控股	240,584,011.11	22.43
9	300025	华星创业	225,582,317.82	21.03
10	300031	宝通科技	225,451,189.03	21.02
11	000158	常山股份	207,458,020.11	19.34
12	300306	远方光电	185,708,011.22	17.31
13	603328	依顿电子	180,063,183.86	16.79
14	601318	中国平安	136,889,092.39	12.76
15	002169	智光电气	132,773,831.90	12.38
16	300017	网宿科技	119,371,713.71	11.13
17	300350	华鹏飞	119,150,604.53	11.11
18	300207	欣旺达	116,917,889.96	10.90
19	300124	汇川技术	113,338,996.28	10.57
20	601169	北京银行	107,768,194.90	10.05
21	002502	骅威文化	100,814,606.94	9.40
22	300370	安控科技	100,611,193.70	9.38
23	601009	南京银行	97,034,831.92	9.05
24	002501	利源精制	92,514,963.81	8.63
25	600028	中国石化	86,960,058.34	8.11
26	600016	民生银行	79,333,054.73	7.40
27	300373	扬杰科技	70,696,157.58	6.59
28	600019	宝钢股份	70,186,277.66	6.54

29	600309	万华化学	69,598,231.23	6.49
30	601939	建设银行	67,564,516.20	6.30
31	600827	百联股份	66,284,829.25	6.18
32	600395	盘江股份	65,210,596.39	6.08
33	000586	汇源通信	64,935,796.57	6.05
34	600837	海通证券	63,919,184.93	5.96
35	000650	仁和药业	61,895,115.58	5.77
36	601688	华泰证券	58,925,470.85	5.49
37	600000	浦发银行	58,655,762.59	5.47
38	002445	中南文化	58,346,167.68	5.44
39	002024	苏宁云商	58,123,151.43	5.42
40	002335	科华恒盛	57,495,994.00	5.36
41	601601	中国太保	56,860,508.07	5.30
42	300231	银信科技	54,574,145.09	5.09
43	000937	冀中能源	52,412,120.72	4.89
44	002142	宁波银行	52,263,140.58	4.87
45	601988	中国银行	52,172,388.00	4.86
46	601818	光大银行	51,978,027.70	4.85
47	000983	西山煤电	51,812,537.41	4.83
48	600804	鹏博士	48,943,595.42	4.56
49	000858	五粮液	46,231,161.52	4.31
50	600570	恒生电子	46,191,119.00	4.31
51	601699	潞安环能	44,472,304.14	4.15
52	000807	云铝股份	43,470,034.22	4.05
53	601328	交通银行	43,388,411.00	4.05
54	600036	招商银行	43,284,259.82	4.04
55	600497	驰宏锌锗	41,655,887.74	3.88
56	300269	联建光电	41,563,670.03	3.88

57	600297	广汇汽车	41,350,000.00	3.86
58	000709	河钢股份	39,960,754.89	3.73
59	000662	天夏智慧	39,862,274.00	3.72
60	000998	隆平高科	39,475,436.49	3.68
61	300383	光环新网	39,199,853.96	3.65
62	600701	*ST 工新	38,136,612.60	3.56
63	001979	招商蛇口	36,813,332.01	3.43
64	601398	工商银行	36,726,896.50	3.42
65	002073	软控股份	36,354,529.17	3.39
66	300367	东方网力	36,187,056.93	3.37
67	600519	贵州茅台	35,956,625.51	3.35
68	600867	通化东宝	35,059,219.06	3.27
69	002446	盛路通信	34,653,556.05	3.23
70	600598	北大荒	34,636,276.20	3.23
71	000878	云南铜业	33,594,553.70	3.13
72	300365	恒华科技	33,018,674.51	3.08
73	600362	江西铜业	32,869,951.63	3.06
74	002594	比亚迪	29,999,995.20	2.80
75	000959	首钢股份	29,352,116.33	2.74
76	300219	鸿利智汇	29,194,307.27	2.72
77	000673	当代东方	28,490,685.69	2.66
78	300007	汉威电子	28,448,392.65	2.65
79	600188	兖州煤业	28,221,350.11	2.63
80	600585	海螺水泥	27,425,017.00	2.56
81	600225	天津松江	26,396,833.57	2.46
82	600507	方大特钢	25,755,072.89	2.40
83	000423	东阿阿胶	25,452,209.96	2.37
84	300301	长方集团	25,305,489.60	2.36

85	000928	中钢国际	24,158,633.45	2.25
86	002557	洽洽食品	24,033,136.64	2.24
87	601336	新华保险	23,849,804.28	2.22
88	600015	华夏银行	23,705,929.42	2.21
89	600446	金证股份	22,923,991.75	2.14
90	300433	蓝思科技	22,078,272.95	2.06
91	300170	汉得信息	21,707,390.85	2.02

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	002131	利欧股份	283,910,830.86	26.47
2	300136	信维通信	262,360,896.88	24.46
3	300031	宝通科技	209,633,738.73	19.55
4	000158	常山股份	191,934,266.86	17.90
5	300025	华星创业	187,736,883.26	17.50
6	603328	依顿电子	184,527,086.76	17.20
7	601318	中国平安	156,287,898.90	14.57
8	300017	网宿科技	144,096,480.40	13.44
9	000971	高升控股	143,560,835.87	13.39
10	002475	立讯精密	138,961,204.52	12.96
11	002456	欧菲光	130,584,710.19	12.18
12	002169	智光电气	127,493,623.16	11.89
13	300370	安控科技	127,411,147.90	11.88
14	300207	欣旺达	122,669,845.20	11.44
15	002236	大华股份	107,241,459.31	10.00
16	601169	北京银行	105,539,348.45	9.84

17	300350	华鹏飞	104,006,256.49	9.70
18	002501	利源精制	101,935,908.55	9.50
19	300054	鼎龙股份	99,909,238.09	9.32
20	002502	骅威文化	96,269,487.80	8.98
21	601009	南京银行	94,713,541.22	8.83
22	600028	中国石化	87,652,428.30	8.17
23	600079	人福医药	84,057,190.50	7.84
24	002241	歌尔股份	83,283,528.51	7.77
25	600016	民生银行	79,597,258.89	7.42
26	600019	宝钢股份	72,465,082.70	6.76
27	000586	汇源通信	70,512,985.31	6.57
28	600395	盘江股份	70,044,906.58	6.53
29	300115	长盈精密	69,666,834.80	6.50
30	601939	建设银行	67,159,621.59	6.26
31	600837	海通证券	64,536,849.93	6.02
32	002445	中南文化	61,606,835.04	5.74
33	601688	华泰证券	60,974,241.24	5.69
34	000650	仁和药业	60,111,932.42	5.60
35	600000	浦发银行	58,917,831.62	5.49
36	601601	中国太保	57,897,352.88	5.40
37	002335	科华恒盛	56,843,154.69	5.30
38	000983	西山煤电	55,918,294.05	5.21
39	300231	银信科技	53,531,474.42	4.99
40	601818	光大银行	52,566,504.06	4.90
41	002142	宁波银行	52,189,948.48	4.87
42	000937	冀中能源	51,553,467.20	4.81
43	601988	中国银行	50,390,634.13	4.70
44	000662	天夏智慧	50,178,479.17	4.68

45	000858	五 粮 液	49,904,670.51	4.65
46	600804	鹏博士	49,732,214.02	4.64
47	600570	恒生电子	45,813,738.21	4.27
48	600297	广汇汽车	44,745,112.93	4.17
49	601328	交通银行	43,759,922.92	4.08
50	601699	潞安环能	43,073,496.49	4.02
51	600036	招商银行	42,295,975.76	3.94
52	300269	联建光电	42,265,779.84	3.94
53	600497	驰宏锌锗	42,041,201.47	3.92
54	300383	光环新网	41,708,765.88	3.89
55	600519	贵州茅台	40,259,147.05	3.75
56	600309	万华化学	39,725,660.45	3.70
57	000807	云铝股份	38,657,675.13	3.60
58	000709	河钢股份	38,304,621.16	3.57
59	300373	扬杰科技	37,570,868.04	3.50
60	300007	汉威电子	36,275,859.50	3.38
61	001979	招商蛇口	35,883,149.90	3.35
62	002073	软控股份	35,492,112.45	3.31
63	601398	工商银行	35,262,871.09	3.29
64	300365	恒华科技	35,075,678.59	3.27
65	002446	盛路通信	34,946,267.82	3.26
66	600701	*ST 工新	34,929,813.38	3.26
67	600867	通化东宝	34,644,006.82	3.23
68	300367	东方网力	34,571,824.83	3.22
69	600362	江西铜业	33,879,824.70	3.16
70	000959	首钢股份	32,558,107.67	3.04
71	300219	鸿利智汇	29,930,619.90	2.79
72	000878	云南铜业	29,520,764.17	2.75



73	300306	远方光电	29,019,364.86	2.71
74	600814	杭州解百	28,642,694.62	2.67
75	600188	兖州煤业	28,066,083.51	2.62
76	000673	当代东方	27,229,804.78	2.54
77	000423	东阿阿胶	26,538,119.22	2.47
78	600585	海螺水泥	26,250,683.54	2.45
79	600015	华夏银行	23,843,528.15	2.22
80	601336	新华保险	23,769,767.93	2.22
81	600446	金证股份	23,537,158.00	2.19
82	600507	方大特钢	23,344,883.29	2.18
83	002557	洽洽食品	22,695,189.83	2.12
84	600225	天津松江	22,272,715.54	2.08
85	300301	长方集团	22,235,998.48	2.07
86	300058	蓝色光标	22,202,314.06	2.07
87	002589	瑞康医药	21,640,970.33	2.02

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	8,610,764,411.71
卖出股票收入（成交）总额	7,066,964,184.38

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	129,519,132.60	5.21
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	-	-
7	可转债（可交换债）	6,829,593.60	0.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	136,348,726.20	5.49

### 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	019546	16 国债 18	1,299,610	129,519,132.60	5.21
2	132007	16 凤凰 EB	65,280	6,829,593.60	0.27

### 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

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 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	1,866,541.92
2	应收证券清算款	313,271,516.50
3	应收股利	-
4	应收利息	1,278,605.04
5	应收申购款	2,332,938.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,749,602.18

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.12.5 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。

**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
180,518	7,202.32	763,979,609.77	58.76%	536,168,432.96	41.24%

**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	791,640.98	0.0609%

**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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年3月25日）基金份额总额	1,980,254,871.35
本报告期期初基金份额总额	388,482,212.54
本报告期基金总申购份额	4,632,315,102.59
减:本报告期基金总赎回份额	3,720,649,272.40
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	1,300,148,042.73

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 2015 年起连续 2 年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 4.8 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	3,771,803,621.46	24.12%	2,758,324.35	22.47%	-
湘财证券	2	2,604,899,877.54	16.65%	2,427,535.05	19.78%	-
东吴证券	1	1,784,453,124.02	11.41%	1,126,527.10	9.18%	新增
东方证券	1	1,771,855,211.79	11.33%	1,295,761.65	10.56%	-
招商证券	1	1,738,640,215.12	11.12%	1,619,197.01	13.19%	-
海通证券	1	1,621,660,847.98	10.37%	1,185,917.64	9.66%	-
中泰证券	1	785,713,875.58	5.02%	574,592.18	4.68%	-
华泰证券	1	744,842,193.06	4.76%	544,704.01	4.44%	-
华创证券	1	412,893,176.81	2.64%	384,526.64	3.13%	-
渤海证券	1	303,676,765.83	1.94%	282,812.80	2.30%	-
信达证券	1	100,435,095.00	0.64%	73,447.32	0.60%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	1	-	-	-	-	注 1
华融证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-

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。

注 1：申万宏源原名宏源证券。

### 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	1,742,599.16	1.32%	400,000,000.00	11.98%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	129,980,703.30	98.68%	2,390,000,000.00	71.56%	-	-
中泰证券	-	-	250,000,000.00	7.49%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	300,000,000.00	8.98%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

第一创业	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

## 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、上海证券报、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关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于长期停牌股票（新文化、天龙集团）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、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、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
5	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
6	关于长期停牌股票（朗姿股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
7	关于调整旗下基金在中国邮储银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 12 日
8	关于调整旗下基金在中国银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 12 日
9	关于长期停牌股票（凯撒股份、信质电机、长电科技）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 13 日
10	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、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、上海证券报、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	中国证券报、上海	2016 年 1 月 15 日



	兼职及领薪情况的公告	证券报、公司网站	
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、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 16 日
14	关于长期停牌股票（万科 A）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
15	关于参加爱建证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 29 日
16	关于长期停牌股票（青岛海尔）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 30 日
17	关于调整陆金所资管基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 15 日
18	关于长期停牌股票（凯撒旅游）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 2 日
19	关于调整旗下基金在江南农商银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 3 日
20	关于调整旗下基金中信银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 7 日
21	关于调整浙江同花顺基金销售有限公司基金申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 14 日
22	关于恢复接受兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金一百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 16 日
23	关于长期停牌股票（长安汽车）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 22 日
24	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 22 日
25	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、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 27 日

26	关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 29 日
27	关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 5 日
28	关于调整诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
29	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
30	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 11 日
31	关于长期停牌股票（利欧股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 11 日
32	关于旗下部分基金参加民生银行基金通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 12 日
33	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、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 17 日
34	关于调整旗下基金在珠海盈米财富管理有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 19 日
35	兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金分红公告（第 1 次）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 21 日
36	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 3 日
37	关于长期停牌股票（广电运通）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 15 日
38	关于在上海陆金所资产管理有限公司开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 17 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、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 21 日
40	关于调整诺亚正行申购、定投金额下限的	中国证券报、上海	2016 年 6 月 23 日

	公告	证券报、公司网站	
41	关于调整众禄金融申购、定投金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
42	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 28 日
43	旗下各基金 2016 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
44	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 5 日
45	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 15 日
46	关于在工商银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 18 日
47	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 23 日
48	关于增加北京广源达信投资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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 23 日
49	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
50	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
51	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
52	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、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
53	关于调整旗下部分基金在指定销售机构的申购、定投、最低赎回、转换转出及最低持有份额限制的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
54	关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司	中国证券报、上海	2016 年 8 月 4 日

	司为旗下部分基金销售机构的公告	证券报、公司网站	
55	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、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 11 日
56	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、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 16 日
57	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、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
58	关于调整旗下基金在长江证券定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
59	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起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
60	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、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 2 日
61	关于调整旗下基金在中信建投证券申购、定期定额申购起点金额及参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 5 日
62	关于调整网上直销部分基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 19 日
63	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、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 20 日
64	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、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 15 日
65	关于调整旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 25 日
66	关于旗下部分基金参加中信证券（山东）申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 2 日
67	关于调整旗下基金在和讯信息科技有限公司申购、定期定额申购起点金额及参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 10 日

68	关于增加华西证券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、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 17 日
69	关于办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 21 日
70	关于调整网上直销部分基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 22 日
71	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 29 日
72	关于开通旗下基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 1 日
73	关于调整旗下部分基金在天天基金	-	-
74	定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 2 日
75	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、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 12 日
76	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、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 14 日
77	关于旗下基金参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 22 日
78	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、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 22 日
79	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 29 日
80	关于旗下部分基金参加中国工商银行“2017 倾心回馈”基金定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 30 日

81	关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 30 日
82	关于旗下基金参加中国农业银行开放式基金交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、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、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

### 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