

兴全有机增长灵活配置混合型 证券投资基金

2016 年半年度报告

2016 年 6 月 30 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§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	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	37
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	37
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	37
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	39
§9 开放式基金份额变动.....	40
§10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	42
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 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	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,046,370,160.11 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		兴业全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张志永

	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 号
办公地址		上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址）
邮政编码		200122	200041
法定代表人		庄园芳	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业全球基金管理有限公司	上海市浦东新区张杨路 500 号时代广场 19-20 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	103,357,370.11
本期利润	68,064,371.51
加权平均基金份额本期利润	0.1005
本期加权平均净值利润率	4.35%
本期基金份额净值增长率	0.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	958,295,524.83
期末可供分配基金份额利润	0.9158
期末基金资产净值	2,004,665,684.94
期末基金份额净值	1.9158
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)

基金份额累计净值增长率	177.57%
-------------	---------

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.98%	1.02%	0.04%	0.50%	2.94%	0.52%
过去三个月	1.12%	0.90%	-0.96%	0.51%	2.08%	0.39%
过去六个月	0.54%	1.39%	-6.77%	0.92%	7.31%	0.47%
过去一年	2.76%	1.53%	-12.73%	1.14%	15.49%	0.39%
过去三年	144.79%	1.65%	30.63%	0.91%	114.16%	0.74%
自基金合同生效起至今	177.57%	1.38%	36.57%	0.82%	141.00%	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：

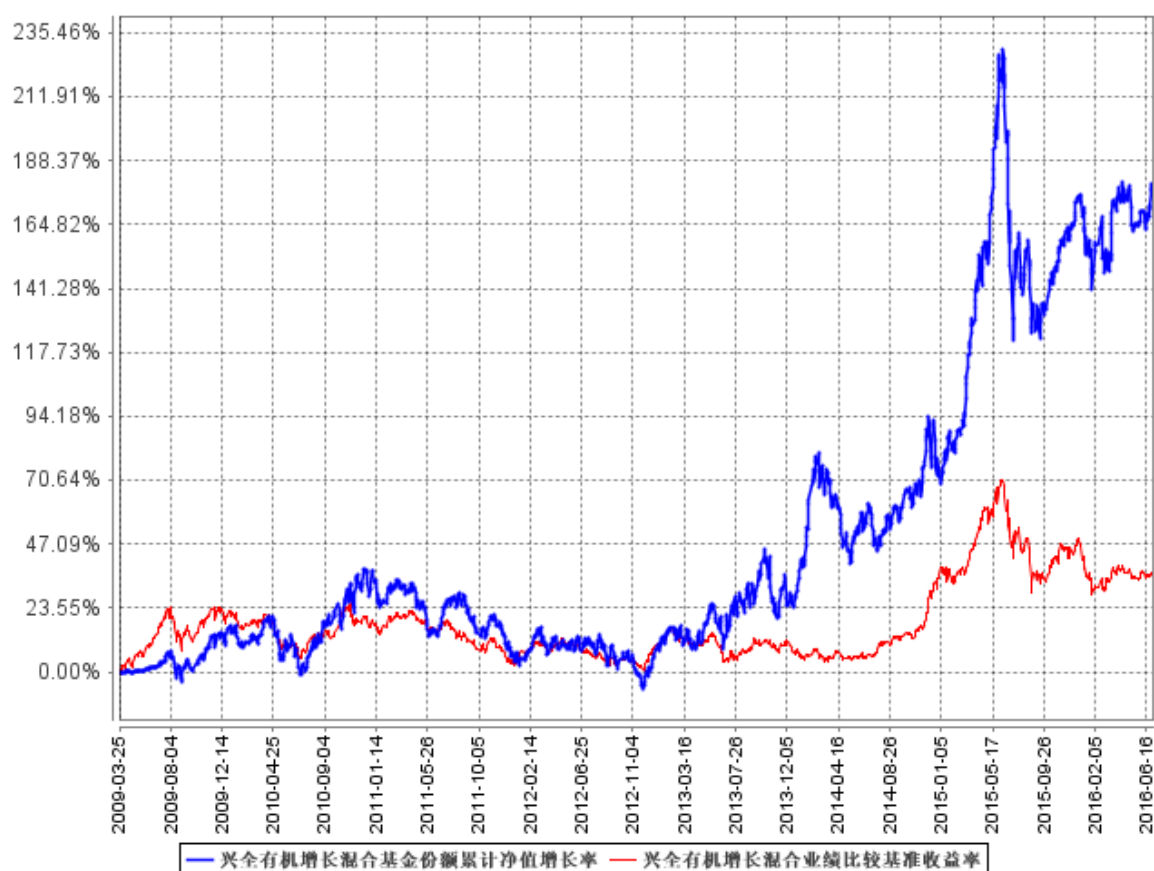
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{中证国债指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

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 6 月 30 日。

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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业全球基金管理有限公司是经中国证监会（证监基金[2003]100 号文）批准，于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月 2 日，中国证监会批准（证监许可[2008]6 号）了公司股权变更申请，

全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”。2008 年 7 月 7 日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币 1.2 亿元变更为人民币 1.5 亿元。

截止 2016 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十七只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季侃乐	本基金基金经理	2015 年 12 月 31 日	-	7 年	管理学硕士，历任兴业全球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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本

报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年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，造成市场短期大幅调整。由于去年第四季度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，宽松的流动性预期逐步产生边际的变化，因此在未来一段时间内市场很可能面临整体估值收缩的局面。本基金今年年初仓位水平较低，一定程度抵御了市场下跌的风险。

二季度整体市场呈现区间震荡的格局，由于一季度的大幅下跌一定程度上缓解了整体市场价格过高的压力，因此在二季度市场出现了分化的格局，一部分景气向上的行业在二季度获得了较好的表现，如新能源、半导体、家电、白酒等。本基金在二季度整体在中性偏上仓位运行，对估值与成长性匹配度较好的标的进行波段操作，取得一定的收益，但仍有部分标的未达到预期的价值兑现。

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 0.54%，同期业绩比较基准收益率-6.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济仍然处于弱势探底的态势，市场的高估值也是市场的风险因素，市场有利的方面就是上半年市场的大幅调整降低了整体市场的下行风险与做空的动能以及权重板块的

估值水平并没有显著地泡沫成分。综合以上因素我们判断市场在未来较长时间可能会维持震荡走势，投资者通过投资指数获得高回报的可能性较小，未来的市场机会更多的以独立分化的形式出现，但由于整体市场机会有限因此往往这些有限的标的会在短期得到市场的充分认知与反应，这对管理人在研究的前瞻性与投资操作的响应速度都提出了一定的考验。在此背景下，管理人将采取自下而上的策略，以成长作为选股标准，以价值作为决策依据，淡化对短期市场风格偏好与追逐的判断与博弈，重点通过公司业绩的中长期增长来获得投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经历，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《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，本报告期内进行利润分配 1 次，共分配利润 3,484,848,330.23 元，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	665,813,660.43	602,292,356.25
结算备付金		11,550,880.86	502,867.50
存出保证金		2,211,234.36	760,722.81
交易性金融资产	6.4.7.2	1,597,031,268.68	416,599,703.50
其中：股票投资		1,597,031,268.68	375,803,873.50
基金投资		-	-
债券投资		-	40,795,830.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		107,486,821.03	51,101,632.87
应收利息	6.4.7.5	506,052.55	2,526,222.66
应收股利		-	-
应收申购款		613,731.65	1,704,523.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,385,213,649.56	1,075,488,029.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		370,202,041.66	599,807.66
应付管理人报酬		2,831,764.82	1,329,780.93
应付托管费		471,960.80	221,630.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,314,630.47	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	6.4.7.8	1,727,566.87	459,083.87
负债合计		380,547,964.62	2,955,852.37
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,046,370,160.11	388,482,212.54
未分配利润	6.4.7.10	958,295,524.83	684,049,964.44
所有者权益合计		2,004,665,684.94	1,072,532,176.98
负债和所有者权益总计		2,385,213,649.56	1,075,488,029.35

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9158 元，基金份额总额 1,046,370,160.11 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		95,313,015.81	668,639,499.53
1.利息收入		7,774,880.78	3,560,973.44
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,564,534.66	2,311,688.71
债券利息收入		12,848.14	1,233,817.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		197,497.98	15,466.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		115,014,160.66	712,339,934.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	112,381,439.26	672,618,240.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,015,895.25	38,451,601.65
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,648,616.65	1,270,092.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-35,292,998.60	-48,503,797.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,816,972.97	1,242,388.99
减：二、费用		27,248,644.30	20,425,344.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,303,392.84	10,661,323.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,883,898.78	1,776,887.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	13,909,739.29	7,807,556.09
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	6.4.7.20	151,613.39	168,241.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,064,371.51	648,214,155.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,064,371.51	648,214,155.06

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	68,064,371.51	68,064,371.51
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)	657,887,947.57	3,691,029,519.11	4,348,917,466.68
其中：1.基金申购款	4,042,543,866.20	6,586,680,183.52	10,629,224,049.72
2.基金赎回款	-3,384,655,918.63	-2,895,650,664.41	-6,280,306,583.04
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)	1,046,370,160.11	958,295,524.83	2,004,665,684.94
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	648,214,155.06	648,214,155.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-364,934,951.66	-468,918,615.40	-833,853,567.06
其中：1.基金申购款	280,701,942.06	340,827,659.31	621,529,601.37
2.基金赎回款	-645,636,893.72	-809,746,274.71	-1,455,383,168.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	463,174,309.12	787,903,371.83	1,251,077,680.95

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金(原名兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金)(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2008]1395 号文《关于核准兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴业全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于 2009 年 3 月 25 日正式生效,首次设立募集规模为 1,980,254,871.35 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于 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“沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%”。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作。另，自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内将全面推开营业税改征增值税。主要税项列示如下：

1) 以发行基金方式募集资金，不属于增值税征收范围，不缴纳增值税。

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

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的

个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5) 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 9 月 19 日起，出让方按 0.1% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	665,813,660.43
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—
合计：	665,813,660.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,544,194,132.25	1,597,031,268.68	52,837,136.43
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	1,544,194,132.25	1,597,031,268.68	52,837,136.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	251,545.56
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	4,678.11
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	248,933.29
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	895.59
合计	506,052.55

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	5,314,630.47
银行间市场应付交易费用	—
合计	5,314,630.47

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,394,377.30

预提费用	123,321.38
其他	209,868.19
合计	1,727,566.87

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	388,482,212.54	388,482,212.54
本期申购	4,042,543,866.20	4,042,543,866.20
本期赎回(以“-”号填列)	-3,384,655,918.63	-3,384,655,918.63
- 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	1,046,370,160.11	1,046,370,160.11

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	646,131,863.06	37,918,101.38	684,049,964.44
本期利润	103,357,370.11	-35,292,998.60	68,064,371.51
本期基金份额交易产生的变动数	3,785,190,308.13	-94,160,789.02	3,691,029,519.11
其中：基金申购款	7,047,953,447.11	-461,273,263.59	6,586,680,183.52
基金赎回款	-3,262,763,138.98	367,112,474.57	-2,895,650,664.41
本期已分配利润	-3,484,848,330.23	-	-3,484,848,330.23
本期末	1,049,831,211.07	-91,535,686.24	958,295,524.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,244,397.69
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	60,821.81
其他	259,315.16

合计	7,564,534.66
----	--------------

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,683,180,617.74
减：卖出股票成本总额	4,570,799,178.48
买卖股票差价收入	112,381,439.26

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,015,895.25
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

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	43,007,064.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	41,758,494.41
减：应收利息总额	2,264,465.02
买卖债券差价收入	-1,015,895.25

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,648,616.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,648,616.65

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-35,292,998.60
——股票投资	-36,255,663.01
——债券投资	962,664.41
——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	-35,292,998.60

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	7,753,346.42
转换费收入	63,626.55
其他	-
合计	7,816,972.97

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	13,909,739.29
银行间市场交易费用	-
合计	13,909,739.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
审计费用	23,869.30
信息披露费	99,452.08
账户维护费用	27,300.00
银行费用	992.01
其他	-
合计	151,613.39

6.4.7.21 分部报告

无。

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴业全球基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,303,392.84	10,661,323.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,444,886.67	2,308,402.31

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

6.4.10.2.2 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6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,883,898.78	1,776,887.19

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
期初持有的基金份额	4,151,718.98	-
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	4,151,718.98	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3968%	-

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

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	665,813,660.43	7,244,397.69	334,373,393.00	2,261,249.73

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

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, 353, 518, 051.23	131, 330, 279.00	3, 484, 848, 330.23		
合计	-	-		8.2003, 353, 518, 051.23	131, 330, 279.00	3, 484, 848, 330.23		

6.4.12 期末（ 2016 年 6 月 30 日 ） 本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单位：股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
600758	红阳 能源	2015 年 12 月 18 日	2016 年 12 月 15 日	非公开 发行流 通受限	8.01	9.32	1,248,314	9,998,995.14	11,634,286.48	-
600162	香江 控股	2015 年 12 月 24 日	2016 年 12 月 19 日	非公开 发行流 通受限	6.02	4.08	1,120,000	6,742,400.00	4,569,600.00	-
600162	香江 控股	2016 年 6 月 27 日	2016 年 12 月 19 日	非公开 发行流 通受限- 转增	-	4.08	560,000	-	2,284,800.00	注 1
300508	维宏 股份	2016 年 4 月 12 日	2017 年 4 月 19 日	新股流 通受限	20.08	254.50	10,383	208,490.64	2,642,473.50	-
601966	玲珑	2016 年 6	2016	新股流	12.98	12.98	15,341	199,126.18	199,126.18	-

	轮胎	月 24 日	年 7 月 6 日	通受限						
603016	新宏泰	2016 年 6 月 23 日	2016 年 7 月 1 日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016 年 6 月 30 日	2016 年 7 月 8 日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016 年 6 月 29 日	2016 年 7 月 7 日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

注 1：本基金持有的非公开发行股票香江控股，于 2016 年 6 月 27 日实施 2015 年度资本公积金转增股本方案，每股派发现金红利 0.09 元，以资本公积向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 560,000 股。

上述流通受限证券可流通日系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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002452	长高集团	2016 年 6 月 14 日	筹划重大事项	12.02	2016 年 7 月 12 日	10.82	217,723	2,527,771.24	2,617,030.46	-
002465	海格通信	2016 年 6 月 9 日	筹划重大事项	12.44	-	-	196,900	2,311,150.67	2,449,436.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家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。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	665,813,660.43	-	-	-	-	-	665,813,660.43
结算备付金	11,550,880.86	-	-	-	-	-	11,550,880.86
存出保证金	2,211,234.36	-	-	-	-	-	2,211,234.36
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,597,031,268.68	1,597,031,268.68
应收证券清算款	-	-	-	-	-	107,486,821.03	107,486,821.03
应收利息	-	-	-	-	-	506,052.55	506,052.55
应收申购款	16,376.41	-	-	-	-	597,355.24	613,731.65
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	679,592,152.06	-	-	-	-	1,705,621,497.50	2,385,213,649.56
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	370,202,041.66	370,202,041.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,831,764.82	2,831,764.82
应付托管费	-	-	-	-	-	471,960.80	471,960.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,314,630.47	5,314,630.47
其他负债	-	-	-	-	-	1,727,566.87	1,727,566.87
负债总计	-	-	-	-	-	380,547,964.62	380,547,964.62
利率敏感度缺口	679,592,152.06	-	-	-	-	1,325,073,532.88	2,004,665,684.94
本期末 2015 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	利率 +1%	-	-3,198.12
	利率 -1%	-	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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 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：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,597,031,268.68	79.67	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	-	-	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	1,597,031,268.68	79.67	416,599,703.50	38.84

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2016 年 6 月 30 日)	上年度末 (2015 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准-10%	-413,441,498.28	-66,768,377.58
	业绩比较基准+10%	413,441,498.28	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。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,597,031,268.68	66.96
	其中: 股票	1,597,031,268.68	66.96
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-

	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	677,364,541.29	28.40
7	其他各项资产	110,817,839.59	4.65
8	合计	2,385,213,649.56	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,107,903,046.08	55.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,634,286.48	0.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	43,550,000.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	82,455,219.00	4.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	344,634,317.12	17.19
J	金融业	-	-
K	房地产业	6,854,400.00	0.34
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	1,597,031,268.68	79.67

7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300115	长盈精密	7,182,548	147,960,488.80	7.38
2	002131	利欧股份	8,649,908	147,826,927.72	7.37
3	000158	常山股份	10,565,307	146,752,114.23	7.32
4	002456	欧菲光	4,678,977	138,029,821.50	6.89
5	002241	歌尔股份	4,780,611	137,107,923.48	6.84
6	603328	依顿电子	4,107,846	121,345,770.84	6.05
7	002236	大华股份	8,872,077	116,224,208.70	5.80
8	000971	高升控股	4,396,564	109,562,374.88	5.47
9	300306	远方光电	3,946,641	93,653,790.93	4.67
10	300025	华星创业	5,894,843	84,532,048.62	4.22
11	300350	华鹏飞	2,309,670	82,455,219.00	4.11
12	002169	智光电气	3,624,340	82,453,735.00	4.11
13	002501	利源精制	6,347,256	68,550,364.80	3.42
14	300370	安控科技	4,409,069	50,087,023.84	2.50
15	600297	广汇汽车	5,000,000	43,550,000.00	2.17
16	600758	红阳能源	1,248,314	11,634,286.48	0.58
17	600162	香江控股	1,680,000	6,854,400.00	0.34
18	300508	维宏股份	10,383	2,642,473.50	0.13
19	002452	长高集团	217,723	2,617,030.46	0.13
20	002465	海格通信	196,900	2,449,436.00	0.12
21	601127	小康股份	8,662	206,761.94	0.01
22	601966	玲珑轮胎	15,341	199,126.18	0.01
23	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.00
24	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.00
25	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.00
26	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.00
27	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.00
28	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
29	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
30	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
31	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002131	利欧股份	217,125,196.24	20.24
2	002236	大华股份	185,363,287.71	17.28
3	603328	依顿电子	180,063,183.86	16.79
4	002456	欧菲光	171,280,487.93	15.97
5	002241	歌尔股份	162,456,770.88	15.15
6	300115	长盈精密	157,239,266.74	14.66
7	000158	常山股份	157,131,009.34	14.65
8	002169	智光电气	122,758,586.50	11.45
9	000971	高升控股	121,405,698.53	11.32
10	300017	网宿科技	119,371,713.71	11.13
11	002475	立讯精密	118,075,313.36	11.01
12	300207	欣旺达	116,917,889.96	10.90
13	601318	中国平安	116,890,005.39	10.90
14	601169	北京银行	107,768,194.90	10.05
15	300136	信维通信	102,036,867.39	9.51
16	002502	骅威文化	100,814,606.94	9.40
17	300370	安控科技	100,611,193.70	9.38
18	002501	利源精制	92,514,963.81	8.63
19	300350	华鹏飞	87,873,234.03	8.19
20	300306	远方光电	86,256,932.70	8.04
21	600016	民生银行	79,333,054.73	7.40
22	601009	南京银行	74,715,524.92	6.97
23	300025	华星创业	74,391,458.64	6.94
24	600019	宝钢股份	70,186,277.66	6.54
25	600395	盘江股份	65,210,596.39	6.08
26	000586	汇源通信	64,935,796.57	6.05
27	600837	海通证券	63,919,184.93	5.96
28	000650	仁和药业	61,895,115.58	5.77
29	601688	华泰证券	58,925,470.85	5.49
30	600000	浦发银行	58,655,762.59	5.47
31	002445	中南文化	58,346,167.68	5.44

32	002335	科华恒盛	57,495,994.00	5.36
33	601601	中国太保	56,860,508.07	5.30
34	600028	中国石化	55,856,682.39	5.21
35	300231	银信科技	54,574,145.09	5.09
36	002142	宁波银行	52,263,140.58	4.87
37	601818	光大银行	51,978,027.70	4.85
38	600804	鹏博士	48,943,595.42	4.56
39	601699	潞安环能	44,472,304.14	4.15
40	600036	招商银行	43,284,259.82	4.04
41	300269	联建光电	41,563,670.03	3.88
42	600297	广汇汽车	41,350,000.00	3.86
43	000858	五粮液	39,989,970.52	3.73
44	000709	河钢股份	39,960,754.89	3.73
45	000662	天夏智慧	39,862,274.00	3.72
46	000983	西山煤电	39,567,200.51	3.69
47	600701	*ST 工新	38,136,612.60	3.56
48	001979	招商蛇口	36,813,332.01	3.43
49	300367	东方网力	36,187,056.93	3.37
50	600519	贵州茅台	35,956,625.51	3.35
51	600867	通化东宝	35,059,219.06	3.27
52	300383	光环新网	34,899,947.96	3.25
53	002446	盛路通信	34,653,556.05	3.23
54	000807	云铝股份	33,919,751.22	3.16
55	300365	恒华科技	32,639,181.51	3.04
56	601328	交通银行	31,155,599.00	2.90
57	000878	云南铜业	30,899,153.70	2.88
58	601939	建设银行	30,837,450.70	2.88
59	300031	宝通科技	30,280,736.67	2.82
60	000937	冀中能源	29,775,482.11	2.78
61	000959	首钢股份	29,352,116.33	2.74
62	300219	鸿利智汇	29,194,307.27	2.72
63	000673	当代东方	28,490,685.69	2.66
64	300007	汉威电子	28,448,392.65	2.65
65	600188	兖州煤业	28,221,350.11	2.63
66	300373	扬杰科技	27,959,142.12	2.61
67	600585	海螺水泥	27,425,017.00	2.56

68	600309	万华化学	27,362,074.38	2.55
69	600225	天津松江	26,396,833.57	2.46
70	600507	方大特钢	25,755,072.89	2.40
71	300301	长方集团	25,305,489.60	2.36
72	002557	洽洽食品	24,033,136.64	2.24
73	601336	新华保险	23,849,804.28	2.22
74	600015	华夏银行	23,705,929.42	2.21
75	600570	恒生电子	22,945,073.00	2.14
76	600446	金证股份	22,923,991.75	2.14
77	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300017	网宿科技	144,096,480.40	13.44
2	601318	中国平安	136,271,292.90	12.71
3	300207	欣旺达	122,669,845.20	11.44
4	002475	立讯精密	117,145,381.21	10.92
5	300136	信维通信	108,610,030.84	10.13
6	601169	北京银行	105,539,348.45	9.84
7	300054	鼎龙股份	99,909,238.09	9.32
8	002502	骅威文化	96,269,487.80	8.98
9	600079	人福医药	84,057,190.50	7.84
10	002131	利欧股份	80,405,749.78	7.50
11	600016	民生银行	79,597,258.89	7.42
12	300370	安控科技	79,469,654.42	7.41
13	601009	南京银行	73,437,125.59	6.85
14	600019	宝钢股份	72,465,082.70	6.76
15	000586	汇源通信	70,512,985.31	6.57
16	600395	盘江股份	70,044,906.58	6.53
17	002236	大华股份	68,708,566.13	6.41
18	603328	依顿电子	67,792,169.00	6.32
19	600837	海通证券	64,536,849.93	6.02
20	002445	中南文化	61,606,835.04	5.74
21	601688	华泰证券	60,974,241.24	5.69

22	000650	仁和药业	60,111,932.42	5.60
23	600000	浦发银行	58,917,831.62	5.49
24	601601	中国太保	57,897,352.88	5.40
25	002335	科华恒盛	56,843,154.69	5.30
26	600028	中国石化	55,719,255.75	5.20
27	300231	银信科技	53,531,474.42	4.99
28	601818	光大银行	52,566,504.06	4.90
29	002142	宁波银行	52,189,948.48	4.87
30	000662	天夏智慧	50,178,479.17	4.68
31	600804	鹏博士	49,732,214.02	4.64
32	000983	西山煤电	44,148,472.07	4.12
33	000858	五粮液	43,482,684.68	4.05
34	601699	潞安环能	43,073,496.49	4.02
35	600036	招商银行	42,295,975.76	3.94
36	300269	联建光电	42,265,779.84	3.94
37	002456	欧菲光	41,530,369.58	3.87
38	600519	贵州茅台	40,259,147.05	3.75
39	002169	智光电气	39,410,116.25	3.67
40	000709	河钢股份	38,304,621.16	3.57
41	300383	光环新网	37,187,180.88	3.47
42	300007	汉威电子	36,275,859.50	3.38
43	001979	招商蛇口	35,883,149.90	3.35
44	002446	盛路通信	34,946,267.82	3.26
45	600701	*ST 工新	34,929,813.38	3.26
46	600867	通化东宝	34,644,006.82	3.23
47	300365	恒华科技	34,595,737.59	3.23
48	300367	东方网力	34,571,824.83	3.22
49	000959	首钢股份	32,558,107.67	3.04
50	601328	交通银行	32,037,425.32	2.99
51	300373	扬杰科技	31,894,615.61	2.97
52	601939	建设银行	31,485,791.85	2.94
53	000937	冀中能源	30,943,731.26	2.89
54	300031	宝通科技	30,353,282.79	2.83
55	002501	利源精制	30,247,065.89	2.82
56	300219	鸿利智汇	29,930,619.90	2.79
57	000807	云铝股份	29,235,356.13	2.73
58	600814	杭州解百	28,642,694.62	2.67
59	600188	兖州煤业	28,066,083.51	2.62

60	000673	当代东方	27,229,804.78	2.54
61	000878	云南铜业	26,962,598.17	2.51
62	600585	海螺水泥	26,250,683.54	2.45
63	600309	万华化学	26,166,793.24	2.44
64	002241	歌尔股份	24,773,677.30	2.31
65	600015	华夏银行	23,843,528.15	2.22
66	601336	新华保险	23,769,767.93	2.22
67	600446	金证股份	23,537,158.00	2.19
68	600507	方大特钢	23,344,883.29	2.18
69	600570	恒生电子	23,091,962.16	2.15
70	002557	洽洽食品	22,695,189.83	2.12
71	600225	天津松江	22,272,715.54	2.08
72	300301	长方集团	22,235,998.48	2.07
73	300058	蓝色光标	22,202,314.06	2.07
74	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,828,282,236.67
卖出股票收入（成交）总额	4,683,180,617.74

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,211,234.36
2	应收证券清算款	107,486,821.03
3	应收股利	-
4	应收利息	506,052.55
5	应收申购款	613,731.65
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	110,817,839.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
29,940	34,948.90	659,123,076.86	62.99%	387,247,083.25	37.01%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	60,769.28	0.0058%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 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, 042, 543, 866. 20
减：本报告期基金总赎回份额	3, 384, 655, 918. 63
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, 046, 370, 160. 11

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）报告期内基金管理人重大人事变动。

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

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

（2）报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	2,410,592,520.26	22.94%	1,762,869.20	21.25%	-
湘财证券	2	1,530,960,170.64	14.57%	1,426,386.80	17.20%	-
招商证券	1	1,457,624,554.87	13.87%	1,357,486.42	16.37%	-
东吴证券	1	1,323,746,512.25	12.60%	835,683.64	10.07%	-
海通证券	1	974,603,418.30	9.27%	712,726.06	8.59%	-
东方证券	1	836,519,392.45	7.96%	611,749.31	7.38%	-
华泰证券	1	744,842,193.06	7.09%	544,704.01	6.57%	-
中泰证券	1	514,057,523.81	4.89%	375,930.28	4.53%	-
华创证券	1	412,893,176.81	3.93%	384,526.64	4.64%	-
渤海证券	1	303,676,765.83	2.89%	282,812.80	3.41%	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	1,742,599.16	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	1,100,000,000.00	78.57%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	300,000,000.00	21.43%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于长期停牌股票（新文化、天龙集	中国证券报、上海证券	2016 年 1 月 6 日

	团) 估值方法调整的公告	报、基金管理人网站	
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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	2016 年 1 月 13 日
11	关于长期停牌股票（三泰控股）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
12	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2016 年 1 月 15 日
13	关于长期停牌股票（康得新）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	2016 年 6 月 17 日
39	关于调整开放式基金开户证件类型类型的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 21 日
40	关于调整诺亚正行申购、定投金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2016 年 6 月 23 日
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、基金管理人网站	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、基金管理人网站	2016 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xyfunds.com.cn>) 查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

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

兴业全球基金管理有限公司

2016 年 8 月 24 日