

兴全合润分级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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2016 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	63
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	63
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末上市基金前十名持有人	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.4 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	66
§10 开放式基金份额变动	67
§11 重大事件揭示	68
11.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	70
§12 影响投资者决策的其他重要信息	79

§13 备查文件目录.....	79
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	79
13.3 查阅方式.....	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合润分级混合型证券投资基金		
基金简称	兴全合润分级混合		
场内简称	兴全合润		
基金主代码	163406		
前端交易代码	—		
后端交易代码	—		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2010 年 4 月 22 日		
基金管理人	兴全基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	3,662,281,504.20 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2010 年 5 月 31 日		
下属分级基金的基金简称	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
下属分级基金的场内简称	兴全合润	合润 A	合润 B
下属分级基金的交易代码	163406	150016	150017
报告期末下属分级基金份额总额	3,517,875,667.20 份	57,762,334.00 份	86,643,503.00 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过定量与定性相结合精选股票，以追求当期收益与实现长期资本增值。		
投资策略	本基金以定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。		
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数		
风险收益特征	本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均为中高，属于中高风险、中高收益的基金品种。		
下属分级基金的风险收益特征	本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均为中高，属于中高风险、中高收益的基金品种。	根据本基金合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定，合润 A 份额将表现出低风险、预期收益较低的风险收益特征。	根据本基金合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定，合润 B 份额在合润基金份额净值在一定区间内具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般股票型份额更高的风险特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com

客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95555
传真	021-20398858	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	庄园芳	李建红

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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	87,131,187.28	1,358,167,584.72	394,124,689.65
本期利润	-234,618,302.87	1,597,784,748.70	471,026,128.82
加权平均基金份额本期利润	-0.0785	1.6582	0.4530
本期加权平均净值利润率	-6.19%	70.31%	34.35%
本期基金份额净值增长率	-7.50%	87.34%	38.33%
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	2,538,580,822.88	2,146,015,166.65	509,416,631.04
期末可供分配基金份额利润	0.6932	1.8794	0.5208
期末基金资产净值	3,949,873,266.41	3,477,403,108.95	1,590,027,504.25
期末基金份额净值	1.0785	3.0454	1.6256
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	179.87%	202.56%	61.50%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.50%	0.76%	1.08%	0.58%	-6.58%	0.18%
过去六个月	-0.91%	0.81%	4.13%	0.61%	-5.04%	0.20%
过去一年	-7.50%	1.67%	-8.32%	1.12%	0.82%	0.55%

过去三年	139.71%	1.75%	40.67%	1.43%	99.04%	0.32%
过去五年	226.35%	1.56%	40.84%	1.30%	185.51%	0.26%
自基金合同 生效起至今	179.87%	1.49%	11.00%	1.27%	168.87%	0.22%

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

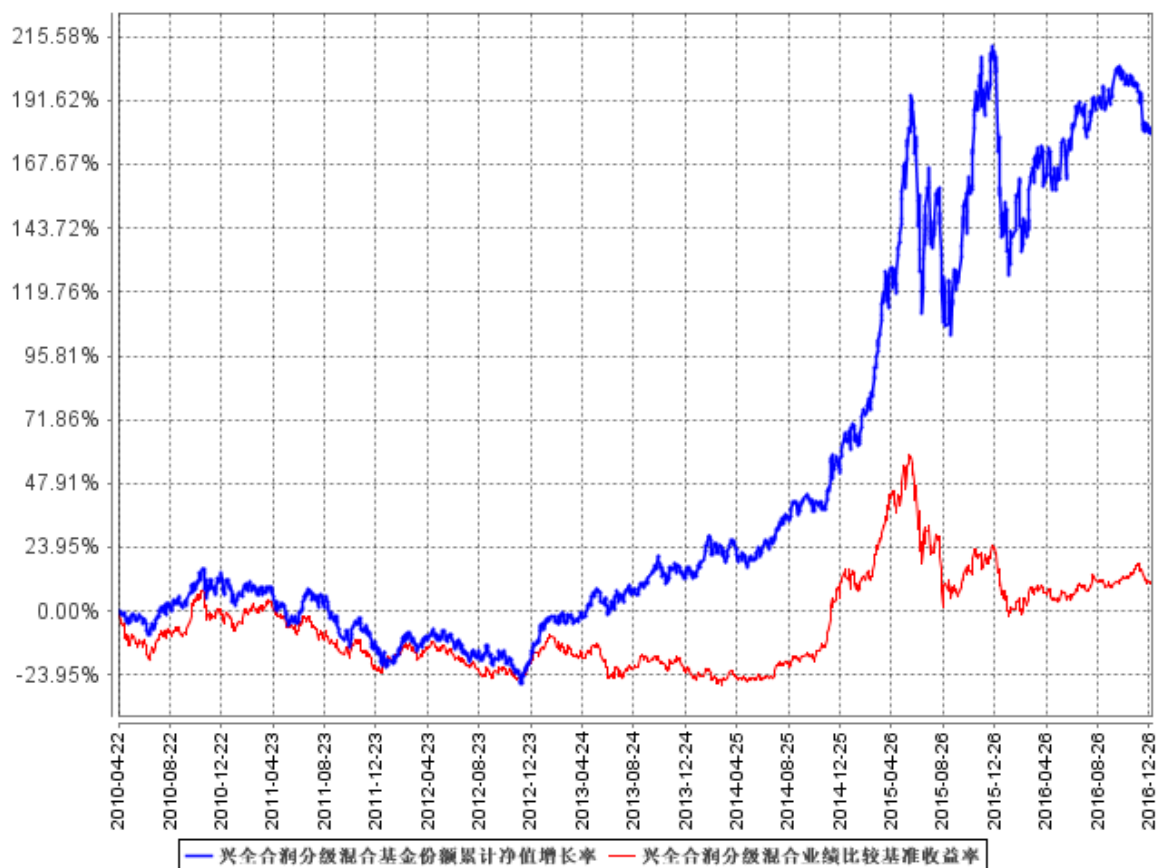
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中证国债指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1)$$

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全合润分级混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

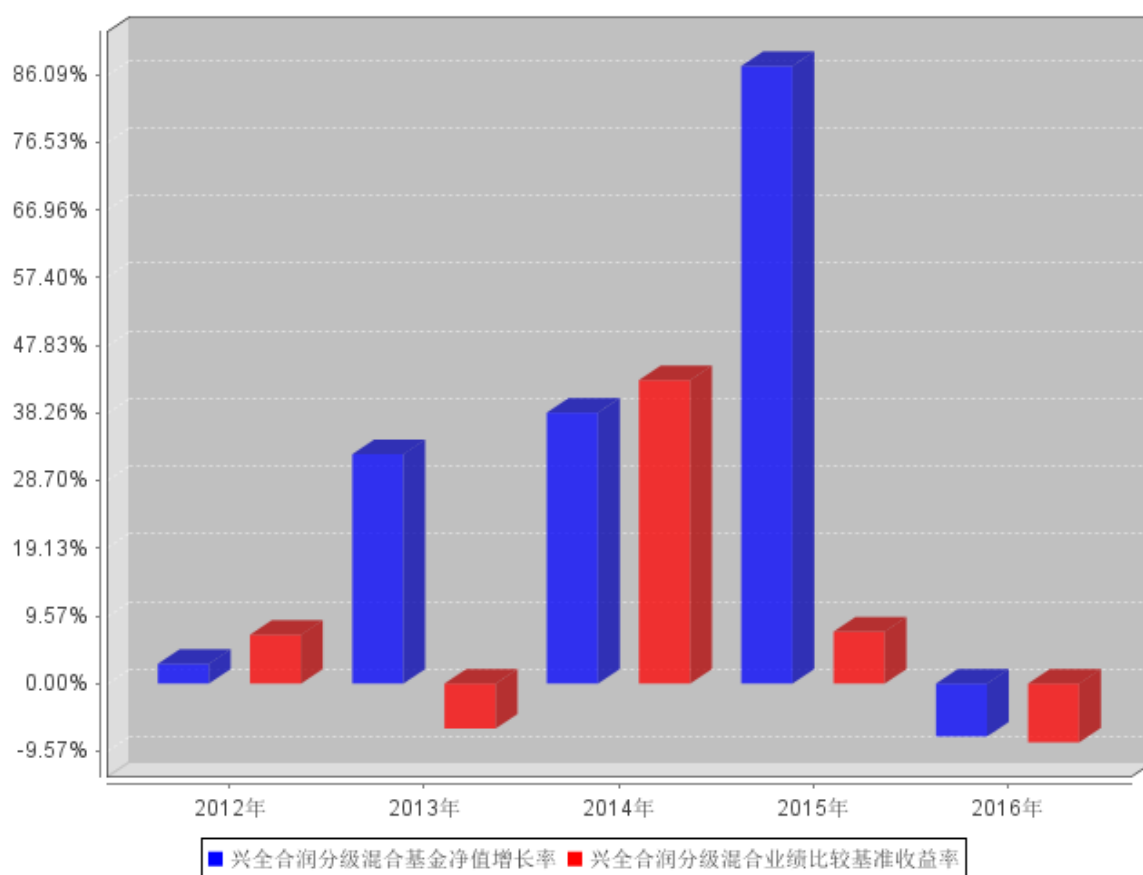


注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 4 月 22 日至 2010 年 10 月 21 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 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

兴全合润分级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



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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

§ 4 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		
谢治宇	基金管理部投资副总监兼本基金、兴	2013 年 1 月 29 日	—	8 年	经济学硕士, 2007 年加入兴全基金管理有限公司, 历任行业研究员、专户投资部任投资

	全轻资产 投资混合 型证券投 资基金 (LOF) 基 金经理				经理。
--	---	--	--	--	-----

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年最初两周，市场出现了意想不到的变化，但后续市场很快进入了稳定的状态。上半年地产景气上行、供给侧改革超预期等因素，带动 2016 年上游行业整体出现了较大的基本面改善，周期品出现了多年未见的景气复苏，并在下半年逐渐传导至下游，消费出现回暖迹象，市场整体呈现持续向上的良好态势。与此同时，创业板高估值的公司，模式逐渐被证伪，叠加监管融资政策趋严等因素影响，板块全年趋势性向下。总体而言，2016 年市场结构性表现差异极大。

本基金年内总体仓位水平变化不大，整体配置以具备中长期逻辑支撑、估值合适的中长期价值品种为主，在控制风险的前提下适当增加了阶段性受益于行业边际改善的周期逻辑品种，总体结构均衡。本基金整体操作仍然本着风险控制的原则，坚定持有以基本面中长期逻辑为基础的品种，结构上较为稳定，均衡配置，降低波动，以期更好地为投资者创造长期价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率-7.50%，同期业绩比较基准收益率-8.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看，实体经济有一定程度的改善，同时股市正表现出极大的结构性特点，在宏观经济数据回暖、融资政策变化、成长股模式逐步被证伪、AH 股互动加强以及 PPP、一带一路等自上而下政策催化等因素叠加下，A 股投资者的投资风格及选股标准正在加剧发生变化，投资者较过去更加重视报表质量扎实、内生增长动力强劲的白马龙头价值股，以及传统行业中持续积累竞争力、有望充分受益经济企稳回暖的边际改善类公司。整体看机构持仓配置结构正在经历一个再平衡的过程，我们认为这样的再平衡过程可能仍将延续一段时间。本基金仍然坚定重点关注那些基本面扎实、报表质量高的中长期价值品种，对于缺乏基本面支撑的纯博弈反弹的品种将抱着更为谨慎的态度。风险收益比是仍然会是本基金重点关注的因素，本基金注重公司基本面和安全边际的逻辑仍然不变，旨在为投资者创造长期稳定的超额收益。

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

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

4.9 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 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 P00867 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	兴全合润分级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合润分级混合型证券投资基金(以下简称“兴全合润分级”)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合润分级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。 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。	
审计意见段	我们认为，兴全合润分级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，公允反映了兴全合润分级 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。	
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：兴全合润分级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
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	344,504,838.29	249,309,630.89
结算备付金		5,748,190.75	17,209,799.54

存出保证金		1,546,502.62	2,325,259.34
交易性金融资产	7.4.7.2	3,641,206,954.45	3,233,772,268.67
其中：股票投资		3,409,147,527.95	3,002,672,062.37
基金投资		-	-
债券投资		232,059,426.50	231,100,206.30
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		19,226,197.96	-
应收利息	7.4.7.5	4,271,553.64	11,917,712.47
应收股利		-	-
应收申购款		5,169,312.80	7,675,936.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,021,673,550.51	3,522,210,607.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	30,778,620.30
应付赎回款		63,064,114.07	4,164,989.20
应付管理人报酬		5,267,391.82	4,307,716.86
应付托管费		877,898.65	717,952.83
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	2,321,812.46	4,557,801.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	269,067.10	280,418.02
负债合计		71,800,284.10	44,807,498.90
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,411,292,443.53	1,149,363,994.06
未分配利润	7.4.7.10	2,538,580,822.88	2,328,039,114.89
所有者权益合计		3,949,873,266.41	3,477,403,108.95
负债和所有者权益总计		4,021,673,550.51	3,522,210,607.85

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0785 元，基金份额总额为 3,662,281,504.20 份，其中：合润基金份额净值 1.0785 元，份额总额 3,517,875,667.20 份；合润 A 基金份额参考净值 1.0000 元，份额总额 57,762,334.00 份；合润 B 基金份额参考净值 1.1308 元，份额总额 86,643,503.00 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全合润分级混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-147,136,350.78	1,665,033,840.18
1. 利息收入		7,426,911.08	9,059,387.63
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,945,289.89	2,151,961.49
债券利息收入		5,177,395.17	6,907,426.14
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		304,226.02	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		164,331,505.66	1,413,625,399.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	142,506,791.32	1,390,622,892.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,211,924.22	7,143,783.03
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	25,036,638.56	15,858,724.06
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-321,749,490.15	239,617,163.98
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,854,722.63	2,731,889.05
减：二、费用		87,481,952.09	67,249,091.48
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	56,680,848.17	33,731,766.74
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,446,807.98	5,621,961.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	20,745,169.92	26,843,350.50
5. 利息支出		52,822.26	644,825.41
其中：卖出回购金融资产支出		52,822.26	644,825.41
6. 其他费用	7.4.7.20	556,303.76	407,187.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-234,618,302.87	1,597,784,748.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-234,618,302.87	1,597,784,748.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全合润分级混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 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）	1,149,363,994.06	2,328,039,114.89	3,477,403,108.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-234,618,302.87	-234,618,302.87
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）	261,928,449.47	445,160,010.86	707,088,460.33
其中：1. 基金申购款	1,159,386,216.33	2,046,702,863.21	3,206,089,079.54
2. 基金赎回款	-897,457,766.86	-1,601,542,852.35	-2,499,000,619.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,411,292,443.53	2,538,580,822.88	3,949,873,266.41
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）	984,532,320.31	605,495,183.94	1,590,027,504.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,597,784,748.70	1,597,784,748.70
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）	164,831,673.75	124,759,182.25	289,590,856.00
其中：1. 基金申购款	1,319,924,462.03	1,662,012,892.18	2,981,937,354.21
2. 基金赎回款	-1,155,092,788.28	-1,537,253,709.93	-2,692,346,498.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,149,363,994.06	2,328,039,114.89	3,477,403,108.95

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

兴全合润分级混合型证券投资基金(原名兴业合润分级股票型证券投资基金)(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]229号文《关于核准兴业合润分级股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人于2010年3月22日至2010年4月16日向社会公开募集,首次设立募集规模为3,328,967,444.30份基金份额;基金合同于2010年4月22日生效。本基金为契约型开放式,存

续期限不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全合润分级股票型证券投资基金，并于 2015 年 8 月 7 日起更名为兴全合润分级混合型证券投资基金。

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

本基金的每个运作期为三年，在运作期到期时，合润 A 份额与合润 B 份额按届时各自份额净值与合润基金份额净值之比折算为合润基金份额，折算后将所有合润基金份额净值调整为 1.0000 元，场内的合润基金份额将以 4:6 的比例分为合润 A 份额和合润 B 份额，并进入下一运作期，并将顺延上一个运作期内合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。

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

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) 本基金不进行收益分配, 运作期内也不单独对合润 A 份额与合润 B 份额进行收益分配;

(2) 经基金份额持有人大会决议通过, 并经中国证监会核准后, 如果终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作, 本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。

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

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金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[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》、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 0.10%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	344,504,838.29	249,309,630.89
定期存款	—	—
其中：存款期限 1-3 个月	—	—
其他存款	—	—
合计：	344,504,838.29	249,309,630.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,360,527,522.72	3,409,147,527.95	48,620,005.23
贵金属投资-金交所 黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	222,557,166.17	222,105,426.50	-451,739.67
	银行间市场	9,979,880.00	9,954,000.00	-25,880.00
	合计	232,537,046.17	232,059,426.50	-477,619.67
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		3,593,064,568.89	3,641,206,954.45	48,142,385.56
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		2,629,758,877.43	3,002,672,062.37	372,913,184.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	183,163,435.40	180,115,206.30	-3,048,229.10
	银行间市场	50,958,080.13	50,985,000.00	26,919.87
	合计	234,121,515.53	231,100,206.30	-3,021,309.23
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,863,880,392.96	3,233,772,268.67	369,891,875.71

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	63,967.45	37,409.11
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,845.37	8,518.84
应收债券利息	4,203,975.33	11,870,633.59

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	765.49	1,150.93
合计	4,271,553.64	11,917,712.47

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,319,976.87	4,557,526.69
银行间市场应付交易费用	1,835.59	275.00
合计	2,321,812.46	4,557,801.69

7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	213,067.10	14,682.44
预提费用	56,000.00	56,000.00
其他	-	209,735.58
合计	269,067.10	280,418.02

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全合润分级混合		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,123,414,848.49	1,130,794,034.63
本期申购	387,808,873.79	390,355,776.74
本期赎回(以“-”号填列)	-259,511,970.03	-261,217,188.97
2016 年 4 月 21 日 基金拆分/份额折算前	1,251,711,752.25	1,259,932,622.40
基金拆分/份额折算变动份额	2,014,378,215.35	-
本期申购	1,999,370,264.40	770,486,388.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,747,584,564.80	-675,943,033.91
本期末	3,517,875,667.20	1,354,475,977.15

金额单位：人民币元

合润 A		
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	7,379,714.00	7,379,714.00
本期申购	475,340.00	475,340.00
本期赎回(以“-”号填列)	-272,168.00	-272,168.00
2016 年 4 月 21 日 基金拆分/份额折算前	7,582,886.00	7,582,886.00
基金拆分/份额折算变动份额	13,582,656.00	-
本期申购	37,380,668.00	19,538,444.01
本期赎回(以“-”号填列)	-783,876.00	-363,127.86
本期末	57,762,334.00	26,758,202.15

金额单位：人民币元

合润 B		
项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,069,572.00	11,190,245.43
本期申购	713,010.00	720,850.31
本期赎回(以“-”号填列)	-408,252.00	-412,741.17
2016 年 4 月 21 日 基金拆分/份额折算前	11,374,330.00	11,498,354.57
基金拆分/份额折算变动份额	20,373,985.00	-
本期申购	56,071,002.00	18,967,821.70
本期赎回(以“-”号填列)	-1,175,814.00	-407,912.04
本期末	86,643,503.00	30,058,264.23

注：1、本基金的基金份额包括合润基金份额、合润 A 份额和合润 B 份额。

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

3、兴全合润基金自基金合同生效日起每三年为一个运作期，2016 年 4 月 21 日为本次运作期到期日，本基金的基金管理人根据基金合同的规定对本基金所有份额进行基金份额定期折算、分拆。当日折算前，兴全合润基金份额净值为 2.6271 元，兴全合润基金份额为 1,251,711,752.25 份，合润 A 份额为 7,582,886.00 份，合润 B 份额为 11,374,330.00。根据基金份额折算比例公式，兴全合润基金份额折算比例为 2.61201317%，折算后兴全合润基金份额为 3,269,487,577.60 份；合润 A 份额与合润 B 份额按各自折算前的份额净值与兴全合润基金份额净值之比折算为合润基金份额，合润 A 份额折算比例为 2.15867769%，折算成兴全合润基金份额为 16,369,006.00 份，合润 B 份额折算比例为 2.91421488%，折算成兴全合润基金份额为 33,147,241.00 份；折算后所有合润基金份额（包括场内份额和场外份额）净值调整为 1.0000 元。基金份额折算后，场内兴全合

润基金份额为 52,913,857.00 份，按照 4:6 的比例分拆成合润 A 份额与合润 B 份额，分拆后份额分别为 21,165,542.00 份和 31,748,315.00 份。

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	2,146,015,166.65	182,023,948.24	2,328,039,114.89
本期利润	87,131,187.28	-321,749,490.15	-234,618,302.87
本期基金份额交易产生的变动数	436,433,482.34	8,726,528.52	445,160,010.86
其中：基金申购款	2,039,649,829.49	7,053,033.72	2,046,702,863.21
基金赎回款	-1,603,216,347.15	1,673,494.80	-1,601,542,852.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,669,579,836.27	-130,999,013.39	2,538,580,822.88

7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,743,274.87	1,926,201.55
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	119,355.79	152,386.44
其他	82,659.23	73,373.50
合计	1,945,289.89	2,151,961.49

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 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
卖出股票成交总额	7,794,016,400.26	10,235,611,384.68
减：卖出股票成本总额	7,651,509,608.94	8,844,988,492.25
买卖股票差价收入	142,506,791.32	1,390,622,892.43

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	-3,211,924.22	7,143,783.03
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-3,211,924.22	7,143,783.03

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	438,367,023.56	186,437,705.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	424,842,300.93	176,550,139.61
减：应收利息总额	16,736,646.85	2,743,783.13

买卖债券差价收入	-3,211,924.22	7,143,783.03
----------	---------------	--------------

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 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
股票投资产生的股利收益	25,036,638.56	15,858,724.06
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	25,036,638.56	15,858,724.06

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-321,749,490.15	239,617,163.98
——股票投资	-324,293,179.71	249,076,763.84
——债券投资	2,543,689.56	-9,459,599.86
——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	-321,749,490.15	239,617,163.98

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,555,099.72	2,536,089.40
转换费收入	89,887.33	195,799.65
其他	209,735.58	-
合计	2,854,722.63	2,731,889.05

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	20,743,819.92	26,843,075.50
银行间市场交易费用	1,350.00	275.00
合计	20,745,169.92	26,843,350.50

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

审计费用	56,000.00	56,000.00
信息披露费	290,000.00	290,000.00
账户维护费用	50,400.00	19,700.00
上市费用	120,000.00	-
银行费用	39,903.76	41,487.77
合计	556,303.76	407,187.77

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，基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人，基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东，基金销售机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
兴业证券	1,311,777,248.69	8.34%	1,677,111,808.93	8.26%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
兴业证券	-	-	145,054,451.22	54.60%

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
兴业证券	-	-	183,400,000.00	9.40%

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
兴业证券	1,229,372.11	10.63%	72,472.16	3.12%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
兴业证券	1,535,209.66	10.56%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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 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
	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	56,680,848.17	33,731,766.74
其中：支付销售机构的客户维护费	8,618,680.00	4,666,513.23

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%/当年天数。

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	9,446,807.98	5,621,961.06

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		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
期初持有的基金份额	4,362,375.11	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	7,032,206.11	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	11,394,581.22	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3111%	-	-

项目	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	4,362,375.11	-	-
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	4,362,375.11	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3820%	-	-

注：1、如果本报告期发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。

2、如果本报告期发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

3、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。

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

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持有本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		2015 年 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
招商银行	344,504,838.29	1,743,274.87	249,309,630.89	1,926,201.55

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

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

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	1,916,376	109,999,982.40	95,205,559.68	-
000413	东旭光电	2016 年 8 月 25 日	2017 年 8 月 28 日	非公开发行流通受限	6.29	8.02	10,492,846	66,000,001.34	84,152,624.92	-
600604	市北高新	2016 年 8 月 31 日	2017 年 8 月 29 日	非公开发行流通受限	15.31	17.11	2,612,670	39,999,977.70	44,702,783.70	-
000690	宝	2016	2017	非公	6.90	8.49	5,072,500	35,000,250.00	43,065,525.00	-

	新 能 源	年 4 月 25 日	年 4 月 26 日	开发 行流 通受 限						
002131	利 欧 股 份	2016 年 9 月 8 日	2017 年 9 月 11 日	非公 开发 行流 通受 限	17.39	15.95	2,300,172	39,999,991.08	36,687,743.40	-
002425	凯 撒 文 化	2016 年 5 月 6 日	2017 年 5 月 9 日	非公 开发 行流 通受 限	21.57	22.34	1,622,600	34,999,482.00	36,248,884.00	注 1
603003	龙 宇 燃 油	2016 年 9 月 28 日	2017 年 9 月 26 日	非公 开发 行流 通受 限	14.66	16.08	2,046,385	30,000,004.10	32,905,870.80	-
603117	万 林 股 份	2016 年 9 月 8 日	2017 年 9 月 6 日	非公 开发 行流 通受 限	16.41	16.50	1,828,153	29,999,990.73	30,164,524.50	-
002590	万 安 科 技	2016 年 2 月 24 日	2017 年 3 月 1 日	非公 开发 行流 通受 限	12.60	19.19	962,600	12,128,760.00	18,472,294.00	-

601137	博威合金	2016年8月18日	2017年8月18日	非公开发行流通受限	11.20	11.90	420,635	4,711,112.00	5,005,556.50	-
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	-
002821	凯莱英	2016年11月11日	2017年11月20日	新股流通受限	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
603823	百合花	2016年12月9日	2017年12月20日	新股流通受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	新股流通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	新股流通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	新股流通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-

002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	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	-
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	-

注：1、自 2016 年 9 月 14 日起，证券简称由“凯撒股份”变更为“凯撒文化”。

2、上述流通受限证券可流通日系本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。

7.4.13 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

300271	华宇 软件	2016 年 12 月 19 日	筹划 重大 事项	17.45	-	-6,336,874	122,100,810.30	110,578,451.30	-
--------	----------	---------------------------	----------------	-------	---	------------	----------------	----------------	---

7.4.13.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.13.1.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13.1.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.14 金融工具风险及管理

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 信用风险

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

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.14.4.1 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。

7.4.14.4.1.1 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	344,504,838.29	-	-	-	-	-	344,504,838.29
结算备付金	5,748,190.75	-	-	-	-	-	5,748,190.75
存出保证金	1,546,502.62	-	-	-	-	-	1,546,502.62
交易性金融资产	-	111,551,000.00	114,192,313.80	6,179,312.70	136,800.00	3,409,147,527.95	3,641,206,954.45
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,226,197.96	19,226,197.96
应收利息	-	-	-	-	-	4,271,553.64	4,271,553.64
应收申购	600,993.05	-	-	-	-	4,568,319.75	5,169,312.80

款							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	352,400,524.71	111,551,000.00	114,192,313.80	6,179,312.70	136,800.00	3,437,213,599.30	4,021,673,550.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	63,064,114.07	63,064,114.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,267,391.82	5,267,391.82
应付托管费	-	-	-	-	-	877,898.65	877,898.65
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,321,812.46	2,321,812.46
其他负债	-	-	-	-	-	269,067.10	269,067.10
负债总计	-	-	-	-	-	71,800,284.10	71,800,284.10
利率敏感度缺口	352,400,524.71	111,551,000.00	114,192,313.80	6,179,312.70	136,800.00	3,365,413,315.20	3,949,873,266.41
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	249,309,630.89	-	-	-	-	-	249,309,630.89
结算备付金	17,209,799.54	-	-	-	-	-	17,209,799.54
存出保证金	2,325,259.34	-	-	-	-	-	2,325,259.34
交易性金融资产	173,639,362.20	-	-	57,460,844.10	-	3,002,672,062.37	3,233,772,268.67
应收利息	-	-	-	-	-	11,917,712.47	11,917,712.47
应收申购款	108,038.48	-	-	-	-	7,567,898.46	7,675,936.94
资产总计	442,592,090.45	-	-	57,460,844.10	-	3,022,157,673.30	3,522,210,607.85
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	30,778,620.30	30,778,620.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,164,989.20	4,164,989.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,307,716.86	4,307,716.86
应付托管费	-	-	-	-	-	717,952.83	717,952.83
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,557,801.69	4,557,801.69
其他负债	-	-	-	-	-	280,418.02	280,418.02

负债总计	-	-	-	-	44,807,498.90	44,807,498.90
利率敏感度缺口	442,592,090.45	-	-57,460,844.10	-	-2,977,350,174.40	3,477,403,108.95

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.14.4.1.2 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%	-649,730.12	-715,808.76
	利率 -1%	655,987.75	733,369.45

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

7.4.14.4.2 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。

7.4.14.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.14.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,409,147,527.95	86.31	3,002,672,062.37	86.35
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	232,059,426.50	5.88	231,100,206.30	6.65
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,641,206,954.45	92.19	3,233,772,268.67	92.99

7.4.14.4.3.2 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%	-324,001,486.46	-309,166,625.47
	业绩比较基准+10%	324,001,486.46	309,166,625.47

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

7.4.14.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.15 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 2,871,905,568.67 元，第二层次的余额为 769,301,385.78 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,487,979,873.85 元，第二层次的余额为 745,792,394.82 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	3,409,147,527.95	84.77
	其中：股票	3,409,147,527.95	84.77
2	固定收益投资	232,059,426.50	5.77
	其中：债券	232,059,426.50	5.77
	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	350,253,029.04	8.71
7	其他各项资产	30,213,567.02	0.75
8	合计	4,021,673,550.51	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	93,646,809.58	2.37
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,313,590,790.92	58.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,065,525.00	1.09

E	建筑业	48,814,399.03	1.24
F	批发和零售业	170,255,409.15	4.31
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	212,960,069.77	5.39
J	金融业	136,481,718.34	3.46
K	房地产业	98,660,242.98	2.50
L	租赁和商务服务业	30,164,524.50	0.76
M	科学研究和技术服务业	244,520,771.40	6.19
N	水利、环境和公共设施管理业	16,977,808.60	0.43
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	3,409,147,527.95	86.31

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	300054	鼎龙股份	10,528,338	230,044,185.30	5.82
2	600584	长电科技	11,690,594	206,338,984.10	5.22
3	300012	华测检测	17,663,836	204,017,305.80	5.17
4	600309	万华化学	8,620,240	185,593,767.20	4.70

5	002425	凯撒文化	7,367,700	166,949,909.00	4.23
6	002582	好想你	4,208,058	148,165,722.18	3.75
7	000423	东阿阿胶	2,261,657	121,835,462.59	3.08
8	000403	ST 生化	3,637,086	119,332,791.66	3.02
9	300271	华宇软件	6,336,874	110,578,451.30	2.80
10	002594	比亚迪	1,916,376	95,205,559.68	2.41
11	601997	贵阳银行	5,990,869	94,535,912.82	2.39
12	002299	圣农发展	4,413,139	93,646,809.58	2.37
13	000858	五 粮 液	2,578,195	88,896,163.60	2.25
14	000413	东旭光电	10,492,846	84,152,624.92	2.13
15	600031	三一重工	12,011,614	73,270,845.40	1.86
16	002024	苏宁云商	6,071,151	69,514,678.95	1.76
17	600335	国机汽车	5,583,116	67,834,859.40	1.72
18	600500	中化国际	5,695,699	66,411,850.34	1.68
19	000425	徐工机械	19,372,549	65,479,215.62	1.66
20	300339	润和软件	2,097,737	64,190,752.20	1.63
21	002250	联化科技	3,931,725	63,615,310.50	1.61
22	600882	广泽股份	5,687,190	61,080,420.60	1.55
23	600521	华海药业	2,752,274	60,632,596.22	1.54
24	000581	威孚高科	2,700,801	60,605,974.44	1.53
25	600240	华业资本	5,023,972	53,957,459.28	1.37
26	300078	思创医惠	2,039,172	52,834,946.52	1.34
27	600502	安徽水利	4,889,660	48,798,806.80	1.24
28	000157	中联重科	9,959,720	45,217,128.80	1.14
29	600604	市北高新	2,612,670	44,702,783.70	1.13
30	601689	拓普集团	1,509,467	44,408,519.14	1.12
31	000690	宝新能源	5,072,500	43,065,525.00	1.09
32	601229	上海银行	1,797,209	41,839,025.52	1.06

33	002355	兴民智通	3,053,786	41,500,951.74	1.05
34	002672	东江环保	2,343,338	41,242,748.80	1.04
35	300410	正业科技	762,381	41,153,326.38	1.04
36	002570	贝因美	3,119,800	40,931,776.00	1.04
37	300284	苏文科	1,947,282	40,503,465.60	1.03
38	002131	利欧股份	2,300,172	36,687,743.40	0.93
39	603003	龙宇燃油	2,046,385	32,905,870.80	0.83
40	002117	东港股份	1,070,970	32,075,551.50	0.81
41	603117	万林股份	1,828,153	30,164,524.50	0.76
42	300083	劲胜精密	3,760,000	27,636,000.00	0.70
43	000338	潍柴动力	2,067,164	20,588,953.44	0.52
44	002590	万安科技	962,600	18,472,294.00	0.47
45	603588	高能环境	542,422	16,977,808.60	0.43
46	601137	博威合金	420,635	5,005,556.50	0.13
47	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	0.08
48	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.03
49	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.03
50	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
51	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
52	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
53	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
54	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
55	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
56	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
57	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
58	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
59	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
60	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00

61	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
62	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
63	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
64	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
65	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
66	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
67	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
68	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
69	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
70	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值 比例（%）
1	000333	美的集团	328,582,000.00	9.45
2	600584	长电科技	218,000,961.89	6.27
3	002425	凯撒文化	216,532,899.71	6.23
4	600309	万华化学	199,602,256.41	5.74
5	002582	好想你	180,249,773.97	5.18
6	002594	比亚迪	178,736,831.43	5.14
7	300012	华测检测	166,451,864.00	4.79
8	002001	新 和 成	149,256,436.57	4.29
9	000423	东阿阿胶	147,768,702.34	4.25
10	600521	华海药业	143,213,614.65	4.12
11	000568	泸州老窖	136,202,987.40	3.92
12	601009	南京银行	127,670,809.19	3.67

13	000858	五 粮 液	123,168,804.06	3.54
14	600519	贵州茅台	121,867,016.67	3.50
15	000403	ST 生化	119,282,516.27	3.43
16	601199	江南水务	117,215,094.30	3.37
17	300271	华宇软件	114,017,681.14	3.28
18	601997	贵阳银行	101,150,664.35	2.91
19	002530	丰东股份	100,931,976.74	2.90
20	600693	东百集团	100,334,429.70	2.89
21	600068	葛洲坝	99,710,460.08	2.87
22	002131	利欧股份	98,740,393.90	2.84
23	002707	众信旅游	96,408,670.03	2.77
24	002456	欧菲光	96,273,906.67	2.77
25	002299	圣农发展	91,854,227.42	2.64
26	000157	中联重科	90,571,237.84	2.60
27	300113	顺网科技	90,258,561.85	2.60
28	002007	华兰生物	89,015,428.72	2.56
29	601166	兴业银行	88,533,978.21	2.55
30	600073	上海梅林	87,944,057.89	2.53
31	601689	拓普集团	86,546,120.25	2.49
32	000895	双汇发展	85,411,507.69	2.46
33	600019	宝钢股份	84,567,904.52	2.43
34	002668	奥马电器	80,848,596.26	2.32
35	002250	联化科技	80,141,827.30	2.30
36	600031	三一重工	79,445,732.01	2.28
37	300339	润和软件	77,730,364.99	2.24
38	600335	国机汽车	75,058,399.67	2.16
39	000758	中色股份	73,939,343.36	2.13
40	600882	广泽股份	72,379,005.23	2.08

41	002557	洽洽食品	72,281,349.91	2.08
42	002024	苏宁云商	71,128,071.64	2.05
43	600498	烽火通信	70,633,601.86	2.03
44	600297	广汇汽车	70,280,000.00	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	000333	美的集团	332,910,427.40	9.57
2	300113	顺网科技	230,958,116.97	6.64
3	002458	益生股份	220,982,071.98	6.35
4	002234	民和股份	199,525,149.54	5.74
5	000568	泸州老窖	184,863,290.49	5.32
6	002001	新 和 成	165,656,662.13	4.76
7	600521	华海药业	157,323,209.77	4.52
8	600519	贵州茅台	152,858,616.74	4.40
9	600693	东百集团	125,073,731.27	3.60
10	601009	南京银行	121,235,120.79	3.49
11	002322	理工环科	118,090,678.28	3.40
12	600068	葛洲坝	117,523,075.87	3.38
13	002456	欧菲光	114,732,403.22	3.30
14	300271	华宇软件	114,492,009.12	3.29
15	601199	江南水务	112,878,753.67	3.25
16	002530	丰东股份	110,132,959.58	3.17
17	002425	凯撒文化	103,131,895.63	2.97
18	002554	惠博普	100,477,693.02	2.89

19	600073	上海梅林	98,106,279.61	2.82
20	002707	众信旅游	96,321,989.30	2.77
21	000895	双汇发展	95,858,263.14	2.76
22	002007	华兰生物	90,199,229.66	2.59
23	601166	兴业银行	85,618,668.25	2.46
24	300063	天龙集团	85,449,676.88	2.46
25	002009	天奇股份	84,439,393.45	2.43
26	600019	宝钢股份	78,916,099.95	2.27
27	002668	奥马电器	75,027,385.54	2.16
28	002488	金固股份	73,632,292.20	2.12
29	600498	烽火通信	72,863,843.78	2.10
30	002557	洽洽食品	72,455,239.07	2.08
31	600297	广汇汽车	71,685,601.09	2.06
32	000513	丽珠集团	71,646,783.02	2.06
33	300012	华测检测	71,418,676.51	2.05
34	300362	天翔环境	70,934,690.86	2.04
35	000858	五 粮 液	70,628,638.08	2.03
36	002594	比亚迪	69,615,443.70	2.00
37	002776	柏堡龙	69,557,103.68	2.00

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	8,382,278,254.23
卖出股票收入（成交）总额	7,794,016,400.26

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	215,789,313.80	5.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,133,312.70	0.41
	其中：政策性金融债	16,133,312.70	0.41
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）	136,800.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	232,059,426.50	5.88

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	019533	16 国债 05	1,115,510	111,551,000.00	2.82
2	019539	16 国债 11	1,043,740	104,238,313.80	2.64
3	070208	07 国开 08	100,000	9,954,000.00	0.25
4	018002	国开 1302	59,070	6,179,312.70	0.16
5	113010	江南转债	1,200	136,800.00	0.00

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	1,546,502.62

2	应收证券清算款	19,226,197.96
3	应收股利	-
4	应收利息	4,271,553.64
5	应收申购款	5,169,312.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,213,567.02

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113010	江南转债	136,800.00	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300271	华宇软件	110,578,451.30	2.80	筹划重大事项
2	002594	比亚迪	95,205,559.68	2.41	非公开发行
3	002425	凯撒文化	36,248,884.00	0.92	非公开发行

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴全合润分级混合	420,381	8,368.30	1,646,666,811.76	46.81%	1,871,208,855.44	53.19%
合润 A	1,356	42,597.59	16,242,074.00	28.12%	41,520,260.00	71.88%
合润 B	1,925	45,009.61	142,300.00	0.16%	86,501,203.00	99.84%
合计	423,662	8,644.35	1,663,051,185.76	45.41%	1,999,230,318.44	54.59%

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

9.2 期末上市基金前十名持有人

合润 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄顺英	4,794,016.00	18.56%
2	黄巍然	2,039,588.00	7.90%
3	鲁利玲	1,523,952.00	5.90%
4	北京能通租赁公司	1,356,676.00	5.25%
5	吕玲	1,111,465.00	4.30%
6	黄德群	1,018,112.00	3.94%
7	黄广通	726,609.00	2.81%
8	徐兰兰	630,000.00	2.44%
9	林汉珍	580,016.00	2.25%

10	曹华	496,762.00	1.92%
----	----	------------	-------

合润 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	黄顺英	5,106,258.00	12.89%
2	黄巍然	3,059,382.00	7.72%
3	陈力	2,772,274.00	7.00%
4	姜学杰	2,011,855.00	5.08%
5	黄德群	1,527,168.00	3.85%
6	黄曲荣	1,456,605.00	3.68%
7	黄广通	1,089,914.00	2.75%
8	叶增	823,710.00	2.08%
9	蔡尚宗	755,146.00	1.91%
10	傅伟铮	643,112.00	1.62%

注：持有人为合润 A、合润 B 份额的场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全合润分级混合	3,739,849.22	0.1063%
	合润 A	0.00	0.0000%
	合润 B	0.00	0.0000%
	合计	3,739,849.22	0.1021%

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

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金	兴全合润分级混合	0

投资和研究部门负责人持有本开放式基金	合润 A	0
	合润 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全合润分级混合	>100
	合润 A	0
	合润 B	0
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全合润分级混合	合润 A	合润 B
基金合同生效日（2010 年 4 月 22 日）基金份额总额	2,992,354,444.30	134,645,200.00	201,967,800.00
本报告期期初基金份额总额	1,123,414,848.49	7,379,714.00	11,069,572.00
本报告期基金总申购份额	2,387,179,138.19	37,856,008.00	56,784,012.00
减:本报告期基金总赎回份额	2,007,096,534.83	1,056,044.00	1,584,066.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	2,014,378,215.35	13,582,656.00	20,373,985.00
本报告期期末基金份额总额	3,517,875,667.20	57,762,334.00	86,643,503.00

§ 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 5.6 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
国信证券	1	3,842,840,018.54	24.43%	2,810,273.33	24.30%	—
国泰君安	2	2,470,458,913.38	15.70%	1,806,644.99	15.62%	—
信达证券	2	1,868,150,032.70	11.87%	1,255,504.07	10.86%	—
广发证券	1	1,593,063,331.70	10.13%	1,165,003.56	10.07%	—
兴业证券	2	1,311,777,248.69	8.34%	1,229,372.11	10.63%	—
安信证券	2	1,182,919,089.93	7.52%	865,073.23	7.48%	—
国金证券	2	788,324,496.92	5.01%	497,669.68	4.30%	—
银河证券	1	730,828,756.87	4.65%	534,456.73	4.62%	—
招商证券	2	486,564,771.62	3.09%	355,824.96	3.08%	—
民生证券	1	338,881,542.03	2.15%	247,825.92	2.14%	—
华创证券	1	321,149,288.68	2.04%	234,857.42	2.03%	—
中信证券	1	290,407,920.20	1.85%	212,375.41	1.84%	—
南京证券	1	214,088,218.90	1.36%	135,154.62	1.17%	—
东方证券	1	180,295,125.74	1.15%	131,846.76	1.14%	—
中信建投	1	112,464,999.37	0.71%	82,245.60	0.71%	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
渤海证券	2	—	—	—	—	—
爱建证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	8,743,363.37	3.73%	-	-	-	-
广发证券	9,217,641.64	3.93%	200,000,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	53,944,659.01	22.98%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	75,662,000.30	32.24%	-	-	-	-
中信证券	87,146,759.43	37.13%	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

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、 证券时报、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、 证券时报、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、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 6 日
4	关于旗下场内基金份额在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 6 日
5	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
6	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
7	关于长期停牌股票（朗姿股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
8	关于调整旗下基金在中国邮储银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 12 日
9	关于调整旗下基金在中国银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 12 日
10	关于长期停牌股票（凯撒股份、信质电机、长电科技）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 13 日
11	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 13 日
12	关于长期停牌股票（三泰控股）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 15 日
13	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 15 日
14	关于长期停牌股票（康得新）估值方	中国证券报、上海证券报、	2016 年 1 月 16 日

	法调整的公告	证券时报、公司网站	
15	关于长期停牌股票（万科 A）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
16	关于参加爱建证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 29 日
17	关于长期停牌股票（青岛海尔）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 1 月 30 日
18	关于调整陆金所资管基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 2 月 15 日
19	关于旗下部分基金投资万安科技（002590）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 2 月 26 日
20	关于长期停牌股票（凯撒旅游）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 2 日
21	关于调整旗下基金在江南农商银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 3 日
22	关于调整旗下基金中信银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 7 日
23	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 8 日
24	关于调整浙江同花顺基金销售有限公司基金申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 14 日
25	关于恢复接受兴全合润分级混合型证券投资基金一百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 16 日
26	关于长期停牌股票（长安汽车）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 3 月 22 日
27	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 11 日

	提示性公告		
28	关于调整部分基金网上直销转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 18 日
29	关于增加诺亚正行（上海）基金销售 投资顾问有限公司为兴全合润基金 销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 18 日
30	关于兴全合润分级混合型证券投资 基金办理定期份额折算业务期间暂 停接受申购、赎回等业务申请的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 18 日
31	关于兴全合润分级混合型证券投资 基金办理定期份额折算、分拆业务的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 18 日
32	关于兴全合润分级混合型证券投资 基金办理定期份额折算、分拆业务期 间合润 A 份额、合润 B 份额停牌的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 22 日
33	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值 方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 22 日
34	关于兴全合润分级混合型证券投资 基金定期份额折算、分拆结果及恢复 交易的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 25 日
35	关于兴全合润分级混合型证券投资 基金之 A 份额、B 份额定期份额折算、 分拆后次日前收盘价调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 25 日
36	关于旗下部分基金投资宝新能源 （000690）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 27 日
37	关于调整招商银行借记卡基金网上 直销优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 4 月 29 日
38	关于官方淘宝店和支付宝基金支付	中国证券报、上海证券报、	2016 年 5 月 5 日

	渠道关闭基金申购等业务的公告	证券时报、公司网站	
39	关于调整诺亚正行（上海）基金销售 投资顾问有限公司基金定投起点的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
40	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
41	关于旗下部分基金投资凯撒股份 （002425）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 10 日
42	关于开通网上直销通联支付业务的 公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 11 日
43	关于长期停牌股票（利欧股份）估值 方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 11 日
44	关于旗下部分基金参加民生银行基 金通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 12 日
45	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、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 17 日
46	关于调整旗下基金在珠海盈米财富 管理有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 5 月 19 日
47	关于调整网上直销基金转换优惠费 率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 3 日
48	关于旗下部分基金投资通裕重工 （300185）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 8 日
49	关于长期停牌股票（广电运通）估值 方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 15 日
50	关于在上海陆金所资产管理有限公司 开通旗下部分基金定期定额投资 业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 17 日
51	关于调整开放式基金开户证件类型 的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 21 日

52	关于增加众禄金融为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
53	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、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
54	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 6 月 28 日
55	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
56	关于兴全合润分级混合型证券投资基金暂停接受一百万元以上申购和转换转入申请的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
57	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 5 日
58	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 15 日
59	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 18 日
60	关于调整旗下部分基金在工商银行基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 19 日
61	关于增加南京证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 20 日
62	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
63	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
64	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 26 日

65	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
66	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、 证券时报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
67	关于增加蛋卷基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 8 日
68	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、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 8 日
69	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、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 11 日
70	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、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 16 日
71	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、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
72	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、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
73	关于旗下部分基金投资博威合金（601137）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 20 日
74	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、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
75	关于旗下部分基金投资东旭光电（000413）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 8 月 27 日
76	关于旗下部分基金投资市北高新（600604）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 2 日
77	关于增加上海基煜基金销售有限公司	中国证券报、上海证券报、	2016 年 9 月 2 日

	司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、公司网站	
78	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、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 5 日
79	关于旗下部分基金投资利欧股份（002131）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 10 日
80	关于旗下部分基金投资万林股份（603117）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 10 日
81	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、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 19 日
82	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、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 20 日
83	关于旗下部分基金投资龙宇燃油（603003）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 9 月 30 日
84	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、 证券时报、公司网站	2016 年 10 月 25 日
85	关于增加北京肯特瑞财富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、 证券时报、公司网站	2016 年 10 月 29 日
86	关于旗下部分基金参加中信证券（山东）基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 2 日
87	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、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 10 日
88	关于增加华西证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 17 日
89	关于办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、	2016 年 11 月 21 日

		证券时报、公司网站	
90	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 22 日
91	关于公司董监高及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 25 日
92	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、 证券时报、公司网站	2016 年 11 月 29 日
93	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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 1 日
94	关于调整旗下部分基金在天天基金定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 2 日
95	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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 12 日
96	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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 14 日
97	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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 22 日
98	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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 22 日
99	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 29 日
100	关于旗下部分基金中国工商银行“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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 30 日

101	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、 证券时报、公司网站	2016 年 12 月 30 日
102	关于旗下基金在中国农业银行关于开放式基金交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、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、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全合润分级混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

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