

兴全可转债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：中国工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。

基金托管人中国工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	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	14

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§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	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§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	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
§12 影响投资者决策的其他重要信息	71
§13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全可转债混合型证券投资基金
基金简称	兴全可转债混合
场内简称	—
基金主代码	340001
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	2004 年 5 月 11 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,029,909,628.82 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	在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴全可转债评价体

	系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398858	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200122	100140
法定代表人		庄园芳	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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	兴全基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	92,061,376.04	875,489,715.16	967,713,687.47
本期利润	11,965,210.78	449,878,270.04	1,467,957,781.24
加权平均基金份额本期利润	0.0061	0.1935	0.6110
本期加权平均净值利润率	0.57%	14.52%	50.63%
本期基金份额净值增长率	0.93%	6.70%	53.29%
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	34,239,226.35	80,684,124.19	779,674,307.58
期末可供分配基金份额利润	0.0169	0.0406	0.2781
期末基金资产净值	2,156,648,214.08	2,232,629,715.96	4,510,935,004.56
期末基金份额净值	1.0624	1.1248	1.6092
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	611.67%	605.11%	560.85%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息

披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.22%	0.35%	-2.74%	0.52%	2.52%	-0.17%
过去六个月	2.27%	0.31%	0.90%	0.48%	1.37%	-0.17%
过去一年	0.93%	0.48%	-10.90%	0.74%	11.83%	-0.26%
过去三年	65.07%	1.16%	8.29%	1.77%	56.78%	-0.61%
过去五年	84.41%	0.98%	11.50%	1.42%	72.91%	-0.44%
自基金合同生效起至今	611.67%	0.86%	109.46%	1.22%	502.21%	-0.36%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：选取中证可转换债券指数和沪深 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“中证可转换债券指数”是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。沪深 300 指数代表效果较好。

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：

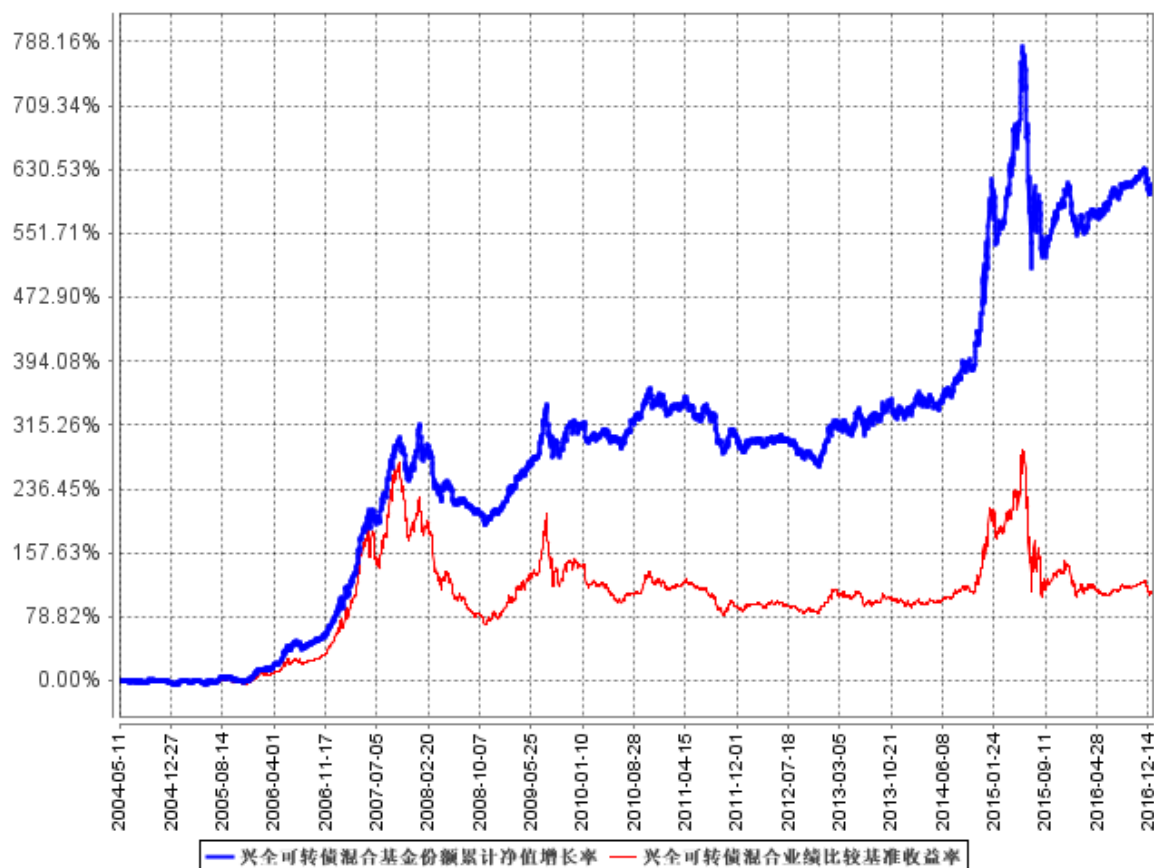
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中证可转换债券指数}_t / \text{中证可转换债券指数}_{t-1} - 1) + 15\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

兴全可转债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

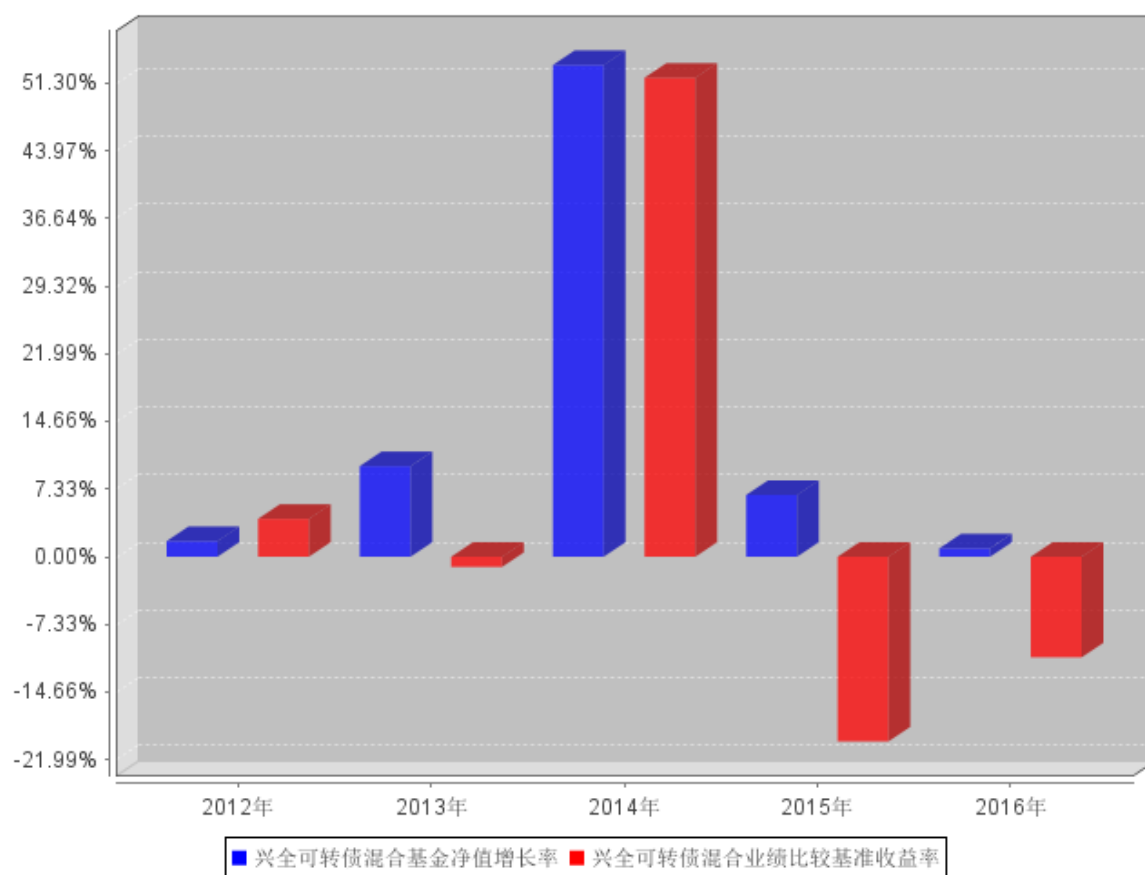


注：1、净值表现所取数据截至到 2016 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2004 年 5 月 11 日至 2004 年 11 月 10 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

兴全可转债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

单位：人民币元

年 度	每 10 份基金 份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2016	0.700	28,883,463.34	104,855,664.35	133,739,127.69	
2015	6.220	2,487,792,767.58	895,000,841.25	3,382,793,608.83	
2014	0.840	71,988,559.39	129,968,716.38	201,957,275.77	
合计	7.760	2,588,664,790.31	1,129,825,221.98	3,718,490,012.29	

§ 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		
张亚辉	本基金、兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2015 年 7 月 13 日	—	11 年	经济学学士。历任兴全基金管理有限公司渠道经理、财务会计、固定收益交易员、专户投资部投资经理。

	理				
陈宇	本基金基金经理	2015 年 8 月 25 日	—	10 年	理学硕士。历任兴业证券研究员、兴全基金管理有限公司研究员、兴全基金管理有限公司专户投资部投资经理。

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、《兴全可转债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 年是宏观经济企稳复苏的一年，特别是中上游产业为代表的传统产业，企业盈利逐季好转，特别是上游原材料和大宗商品，迎来久违的上涨。好转的原因一方面在于地产的强劲销售和以 PPP 为代表的财政政策共同拉动了总需求，另一方面在于大宗商品的库存周期叠加了国内的供给侧改革边际上减少了供给。

以《七问供给侧改革》、权威人士讲话等文章为代表，去杠杆、调结构、国企改革的方针政策贯穿了 2016 年全年，政府的工作重点从上半年的稳增长转变为控风险、防泡沫，与之对应的货币政策大体上前松后“紧”，特别是 4 季度，央行通过 MLF 的量价调整，变相提高了利率。

2016 年是海外的“多事”之年，美联储全年加息一次，英国脱欧和美国总统大选都给全球金融市场带来冲击，特别是美元的强势上涨加大了人民币的贬值预期，也给国内证券市场带来压力，至 2016 年 4 季度，人民币贬值压力基本得到释放，外汇储备的下降也比较平稳可控。

在上述宏观背景下，2016 年股票市场年初下跌熔断，之后逐季回升，特别是传统行业为主的上证综指。中小创股票在 IPO 加速、定向增发受到抑制、深港通开通资金南下等背景下，走势弱于上证综指。债券市场在 10 月之前单边走牛，10 月后货币政策转向后，债券市场快速调整。可转债指数年初跟随股票市场下跌，年中保持平稳，年末跟随债券市场下跌，表现比较弱。

本基金全年维持了较低的转债仓位，上半年少量参与了债券市场的机会，下半年提高了股票仓位，在合同限定的资产比例的框架下，本基金完成了绝对收益的目标。

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为 0.93%，同期业绩比较基准收益率为-10.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年，由于大宗商品库存周期的延续性、国内供给侧改革的深化和房地产销售的粘性，至少上半年经济有相当韧性，同时新能源汽车、高端装备、新材料等新产业仍在成长，去产能、国企改革、去杠杆、解决债务等中长期改革将稳步推进，总体上经济平稳可控，中长期的增长潜力逐步释放。资本市场自身的改革也在逐步推进，比如沪伦通、“准注册制”等。

海外有一些不确定性，美国新任特朗普总统推行了基建、减税等一系列刺激经济的政策，有

可能进一步强化美国经济复苏的势头，同时美联储继续加息，强化美元的升值势头，给国内的货币政策空间带来较大的压力。

经过 2015-2016 年两年的下跌，股票市场的泡沫受到相当程度的积压，在各个大类资产中，有较高的性价比，盈利持续改善、资产价值得到重估的行业有较好的投资机会，经过充分下跌后，部分新兴行业的股票也进入长期配置区间。债券市场可能还将受制于央行稳健偏中性的货币政策，难有前两年趋势性的投资机会。随着银行转债的获批，可转债可能迎来久违的扩容，为投资者提供更多的可操作性，另外，经过 2016 年的大幅下跌，不少可转债品种已经有了一定程度的债底保护，逐步体现出投资价值。本基金仍将秉承“严控下行风险”的优良传统，灵活配置资产，挑选价值类型的个券，尽量追求“安全的收益”。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全可转债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，在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次，收益分配比例不低于净收益的 90%，收益分配后基金份额净值不能低于面值。本报告期内本基金已实施利润分配 3 次，共分配利润 133,739,127.69 元，符合本基金基金合同的相关规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对兴全可转债混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，兴全可转债混合型证券投资基金的管理人——兴全基金管理有限公司在兴全可转债混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴全可转债混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 3 次利润分配，分配金额为 133,739,127.69 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴全基金管理有限公司编制和披露的兴全可转债混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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 P00874 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	兴全可转债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可转债混合型证券投资基金(以下简称“兴全可转债”)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可转债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,兴全可转债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,公允反映了兴全可转债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：兴全可转债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	163, 224, 691. 27	478, 336, 418. 78
结算备付金		4, 905, 113. 74	4, 645, 313. 33
存出保证金		497, 692. 10	997, 122. 36
交易性金融资产	7.4.7.2	1, 964, 685, 902. 07	1, 812, 335, 075. 00
其中：股票投资		467, 884, 158. 13	471, 529, 976. 06
基金投资		-	-
债券投资		1, 496, 801, 743. 94	1, 340, 805, 098. 94
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	20, 000, 000. 00	-
应收证券清算款		-	38, 491, 319. 67
应收利息	7.4.7.5	14, 553, 288. 93	9, 883, 599. 48
应收股利		-	-

应收申购款		716,409.52	881,315.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,168,583,097.63	2,345,570,163.96
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		-	105,000,000.00
应付证券清算款		6,732,747.30	-
应付赎回款		1,489,583.74	3,339,832.74
应付管理人报酬		2,402,818.35	2,513,127.55
应付托管费		462,080.44	483,293.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	765,555.10	1,230,406.14
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	82,098.62	373,787.80
负债合计		11,934,883.55	112,940,448.00
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,029,909,628.82	1,984,975,281.06
未分配利润	7.4.7.10	126,738,585.26	247,654,434.90
所有者权益合计		2,156,648,214.08	2,232,629,715.96
负债和所有者权益总计		2,168,583,097.63	2,345,570,163.96

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0624 元，基金份额总额 2,029,909,628.82

份。

7.2 利润表

会计主体：兴全可转债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		55,676,430.01	523,279,069.74
1. 利息收入		30,797,283.24	28,300,245.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,198,540.27	6,811,454.30
债券利息收入		26,806,038.32	18,957,635.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,792,704.65	2,531,156.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		104,371,889.69	907,391,079.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	96,922,282.25	583,177,279.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,012,578.04	321,963,469.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,437,029.40	2,250,330.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-80,096,165.26	-425,611,445.12
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	603,422.34	13,199,189.85
减：二、费用		43,711,219.23	73,400,799.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	27,143,263.76	40,275,485.86

2. 托管费	7.4.10.2.2	5,219,858.43	7,745,285.77
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	9,214,779.75	22,418,374.83
5. 利息支出		1,799,432.05	2,579,849.39
其中：卖出回购金融资产支出		1,799,432.05	2,579,849.39
6. 其他费用	7.4.7.20	333,885.24	381,803.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,965,210.78	449,878,270.04
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,965,210.78	449,878,270.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全可转债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）	1,984,975,281.06	247,654,434.90	2,232,629,715.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,965,210.78	11,965,210.78
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）	44,934,347.76	858,067.27	45,792,415.03
其中：1. 基金申购款	555,651,563.58	34,343,871.99	589,995,435.57

2. 基金赎回款	-510,717,215.82	-33,485,804.72	-544,203,020.54
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）	-	-133,739,127.69	-133,739,127.69
五、期末所有者权益（基金净值）	2,029,909,628.82	126,738,585.26	2,156,648,214.08
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）	2,803,247,209.18	1,707,687,795.38	4,510,935,004.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	449,878,270.04	449,878,270.04
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）	-818,271,928.12	1,472,881,978.31	654,610,050.19
其中：1. 基金申购款	7,431,149,205.73	4,913,993,438.56	12,345,142,644.29
2. 基金赎回款	-8,249,421,133.85	-3,441,111,460.25	-11,690,532,594.10
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）	-	-3,382,793,608.83	-3,382,793,608.83
五、期末所有者权益（基金净值）	1,984,975,281.06	247,654,434.90	2,232,629,715.96

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

兴全可转债混合型证券投资基金(原名兴业可转债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”)证监基金字[2004]27 号文《关于同意兴业可转债混合型证券投资基金设立的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于 2004 年 5 月 11 日正式生效,首次设立募集规模为 3,282,404,810.93 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴全基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全可转债混合型证券投资基金。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、国债,以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。资产配置比例为:可转债 30%~95%(其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于 50%),股票不高于 30%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率”。

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 1.30% 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) 基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金分红方式；
- (2) 在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次。成立不满 3 个月，则不进行收益分配。期中分配由基金管理人另行公告，年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成；
- (3) 基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；
- (4) 如果基金投资当期出现亏损，则可不进行收益分配；
- (5) 基金收益分配比例不低于净收益的 90%；
- (6) 基金中每一基金份额享有同等分配权；
- (7) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
- (8) 上述规定若根据国家法律、法规以及中国证监会规定发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开持有人大会；
- (9) 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
- 2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。
- 3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
- 5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	163, 224, 691. 27	478, 336, 418. 78
定期存款	—	—
其中: 存款期限 1-3 个月	—	—
其他存款	—	—
合计:	163, 224, 691. 27	478, 336, 418. 78

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	469, 165, 723. 91	467, 884, 158. 13	-1, 281, 565. 78
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	1, 129, 560, 571. 12	1, 121, 235, 743. 94
	银行间市场	372, 321, 128. 45	375, 566, 000. 00
	合计	1, 501, 881, 699. 57	1, 496, 801, 743. 94
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	1, 971, 047, 423. 48	1, 964, 685, 902. 07	-6, 361, 521. 41

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		408,548,292.20	471,529,976.06	62,981,683.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,049,214,319.27	1,059,578,098.94	10,363,779.67
	银行间市场	280,837,819.68	281,227,000.00	389,180.32
	合计	1,330,052,138.95	1,340,805,098.94	10,752,959.99
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,738,600,431.15	1,812,335,075.00	73,734,643.85

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

单位：人民币元

项目		本期末	
		2016 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所		20,000,000.00	-
买入返售证券_银行间		-	-
合计		20,000,000.00	-
项目		上年度末	
		2015 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所		-	-

买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-

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	29,081.18	87,742.80
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	2,207.30	2,090.40
应收债券利息	14,508,026.46	9,793,317.58
应收买入返售证券利息	13,749.99	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	224.00	448.70
合计	14,553,288.93	9,883,599.48

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	755,932.45	1,226,750.20
银行间市场应付交易费用	9,622.65	3,655.94
合计	765,555.10	1,230,406.14

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	2,096.63	5,292.39
应付转换费	1.99	2,761.31
预提信息披露费	—	200,000.00
预提审计费	80,000.00	80,000.00
其他	—	85,734.10
合计	82,098.62	373,787.80

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,984,975,281.06	1,984,975,281.06
本期申购	555,651,563.58	555,651,563.58
本期赎回（以“-”号填列）	-510,717,215.82	-510,717,215.82
- 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	2,029,909,628.82	2,029,909,628.82

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,684,124.19	166,970,310.71	247,654,434.90
本期利润	92,061,376.04	-80,096,165.26	11,965,210.78
本期基金份额交易产生的变动数	-4,767,146.19	5,625,213.46	858,067.27
其中：基金申购款	2,646,203.89	31,697,668.10	34,343,871.99
基金赎回款	-7,413,350.08	-26,072,454.64	-33,485,804.72
本期已分配利润	-133,739,127.69	-	-133,739,127.69
本期末	34,239,226.35	92,499,358.91	126,738,585.26

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	2,079,091.13	6,223,139.45
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	105,903.72	349,022.67
其他	13,545.42	239,292.18
合计	2,198,540.27	6,811,454.30

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	3,234,673,933.65	9,276,278,625.82

减：卖出股票成本总额	3,137,751,651.40	8,693,101,346.46
买卖股票差价收入	96,922,282.25	583,177,279.36

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	3,012,578.04	321,963,469.35
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	3,012,578.04	321,963,469.35

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	1,290,364,022.31	5,626,727,703.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,270,300,958.68	5,275,434,901.37
减：应收利息总额	17,050,485.59	29,329,332.84
买卖债券差价收入	3,012,578.04	321,963,469.35

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未投资贵金属。

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	4,437,029.40	2,250,330.41
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,437,029.40	2,250,330.41

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	-80,096,165.26	-425,611,445.12
——股票投资	-64,263,249.64	-16,406,597.52
——债券投资	-15,832,915.62	-409,204,847.60
——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	-80,096,165.26	-425,611,445.12

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	482,524.35	12,533,216.16
转换费收入	35,163.89	638,644.00
其他	85,734.10	27,329.69
合计	603,422.34	13,199,189.85

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	9,208,629.75	22,416,074.83
银行间市场交易费用	6,150.00	2,300.00
合计	9,214,779.75	22,418,374.83

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	80,000.00	80,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
银行汇划费	16,985.24	15,803.85
帐户维护费	36,900.00	36,000.00
其它费用	-	50,000.00
合计	333,885.24	381,803.85

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

本基金于 2017 年 3 月 30 日对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.21 元进行分红，实际分配收益为人民币 43,437,125.59 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	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	2,791,255,045.78	44.04%	5,039,884,635.08	37.38%

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	125,865,186.94	8.85%	1,425,675,908.19	29.05%

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	20,000,000.00	0.22%	10,298,400,000.00	52.10%

7.4.10.1.4 权证交易

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	2,047,964.47	37.83%	199,812.16	26.43%
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	3,587,155.61	31.06%	-	-

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,143,263.76	40,275,485.86
其中：支付销售机构的客户维护费	4,803,520.71	6,164,355.38

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.30%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×1.30%/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	5,219,858.43	7,745,285.77
----------------	--------------	--------------

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

单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
工商银行	41,195,031.01	-	-	-	-	-

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	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	67,023,209.34
期间申购/买入总份额	-	35,658,812.99

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	102,682,022.33
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	163,224,691.27	2,079,091.13	478,336,418.78	6,223,139.45

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					

1	2016 年 9 月 5 日	-	2016 年 9 月 5 日	0.180	8,181,961.63	27,610,330.26	35,792,291.89	
2	2016 年 6 月 27 日	-	2016 年 6 月 27 日	0.260	10,368,835.97	38,862,301.02	49,231,136.99	
3	2016 年 1 月 25 日	-	2016 年 1 月 25 日	0.260	10,332,665.74	38,383,033.07	48,715,698.81	
合 计	-	-		0.700	28,883,463.34	104,855,664.35	133,739,127.69	

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单位： 股）	期末 成本总额	期末估值总额	备注
002594	比亚迪	2016 年 7 月 22 日	2017 年 7 月 25 日	非公 开发 行流 通受 限	57.40	49.68	522,648	29,999,995.20	25,965,152.64	-
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	682,128	9,999,996.48	10,968,618.24	-

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	609,385	10,000,007.85	10,054,852.50	-
002821	凯莱英	2016年 11月 11日	2017 年11 月20 日	新股 流通 受限	30.53	143.49	21,409	653,616.77	3,071,977.41	-
300508	维宏股份	2016年 4月12 日	2017 年4 月19 日	新股 流通 受限	20.08	121.49	10,383	208,490.64	1,261,430.67	-
603823	百合花	2016年 12月9 日	2017 年12 月20 日	新股 流通 受限	10.60	32.74	36,764	389,698.40	1,203,653.36	-
601375	中原证券	2016年 12月 20日	2017 年1 月3 日	新股 流通 受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603035	常熟汽饰	2016年 12月 27日	2017 年1 月5 日	新股 流通 受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
002840	华统股份	2016年 12月 29日	2017 年1 月10 日	新股 流通 受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-

002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 3 日	新股流通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603032	德新交运	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：上述可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300271	华宇软件	2016 年 12 月 19 日	筹划重大事项	17.45	-	-	701,300	14,125,444.00	12,237,685.00	-

603986	兆易创 新	2016 年 9 月 19 日	筹划重 大事项	177.97	2017 年 3 月 13 日	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
300537	广信材 料	2016 年 10 月 12 日	筹划重 大事项	48.79	2017 年 1 月 13 日	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	163,224,691.27	-	-	-	-	-	163,224,691.27
结算备付金	4,905,113.74	-	-	-	-	-	4,905,113.74
存出保证金	497,692.10	-	-	-	-	-	497,692.10
交易性金融资产	-40,108,000.00	169,917,210.90	869,557,875.46	400,218,657.58	484,884,158.13	-	1,964,685,902.07
买入返售金	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00

融资产							
应收利息	-	-	-	-	-	14,553,288.93	14,553,288.93
应收申购款	71,878.74	-	-	-	-	644,530.78	716,409.52
资产总计	188,699,375.85	40,108,000.00	169,917,210.90	869,557,875.46	400,218,657.58	500,081,977.84	2,168,583,097.63
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6,732,747.30	6,732,747.30
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,489,583.74	1,489,583.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,402,818.35	2,402,818.35
应付托管费	-	-	-	-	-	462,080.44	462,080.44
应付交易费用	-	-	-	-	-	765,555.10	765,555.10
其他负债	-	-	-	-	-	82,098.62	82,098.62
负债总计	-	-	-	-	-	11,934,883.55	11,934,883.55
利率敏感度缺口	188,699,375.85	40,108,000.00	169,917,210.90	869,557,875.46	400,218,657.58	488,147,094.29	2,156,648,214.08
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	478,336,418.78	-	-	-	-	-	478,336,418.78
结算备付金	4,645,313.33	-	-	-	-	-	4,645,313.33
存出保证金	997,122.36	-	-	-	-	-	997,122.36
交易性金融资产	40,016,000.00	30,198,000.00	649,545,374.10	358,962,558.24	262,083,166.60	471,529,976.06	1,812,335,075.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	38,491,319.67	38,491,319.67
应收利息	-	-	-	-	-	9,883,599.48	9,883,599.48

应收申购款	67,367.49	-	-	-	-	813,947.85	881,315.34
资产总计	524,062,221.96	30,198,000.00	649,545,374.10	358,962,558.24	262,083,166.60	520,718,843.06	2,345,570,163.96
负债							
卖出回购金	105,000,000.00	-	-	-	-	-	105,000,000.00
融资产款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,339,832.74	3,339,832.74
应付管理人	-	-	-	-	-	2,513,127.55	2,513,127.55
报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	483,293.77	483,293.77
应付交易费	-	-	-	-	-	1,230,406.14	1,230,406.14
用							
其他负债	-	-	-	-	-	373,787.80	373,787.80
负债总计	105,000,000.00	-	-	-	-	7,940,448.00	112,940,448.00
利率敏感度	419,062,221.96	30,198,000.00	649,545,374.10	358,962,558.24	262,083,166.60	512,778,395.06	2,232,629,715.96
缺口							

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	利率 +1%	-10,055,522.83	-9,265,834.80
	利率 -1%	10,576,906.24	9,533,804.63

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

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为不超过基金资产净值的 30%；可转债为 30%-95%；现金和到期日在一年以内的政府债券的比例在 5%以上。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	467,884,158.13	21.69	471,529,976.06	21.12
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,496,801,743.94	69.40	1,340,805,098.94	60.05
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	1,964,685,902.07	91.10	1,812,335,075.00	81.17

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析

	在业绩基准变化 10%时,对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2016 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2015 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准-10%	-40,508,700.71	-61,689,293.57
	业绩比较基准+10%	40,508,700.71	61,689,293.57

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

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值接近。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 802,750,955.54 元，第二层次的余额为 1,161,934,946.53 元，无属于第三层次的余额 (2015 年 12 月 31 日：第一层次 533,949,639.94 元，第二层次的余额为 1,278,385,435.06 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年度变动金额

无。

(2) 期末持有的暂时停牌等其他流通受限证券

除 7.4.12 所披露的流动受限证券外,本基金于 2016 年 12 月 31 日尚持有流通受限债券电气转债(代码:113008),共计 647,940 张,本期末估值单价为人民币 114.43 元,估值总价为人民币 74,143,774.20 元。该债券于 2016 年 8 月 31 日停牌,截至报告日该债券尚未复牌。

(3)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	467,884,158.13	21.58
	其中:股票	467,884,158.13	21.58
2	固定收益投资	1,496,801,743.94	69.02
	其中:债券	1,496,801,743.94	69.02
	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	20,000,000.00	0.92
	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	168,129,805.01	7.75
7	其他各项资产	15,767,390.55	0.73

8	合计	2,168,583,097.63	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	33,112,809.23	1.54
B	采矿业	40,221.20	0.00
C	制造业	337,812,202.71	15.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	28,289,649.01	1.31
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	31,972,661.72	1.48
J	金融业	18,724,656.80	0.87
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	16,407,611.55	0.76
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	1,499,295.00	0.07
S	综合	—	—
	合计	467,884,158.13	21.69

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	300106	西部牧业	2,052,871	33,112,809.23	1.54
2	002216	三全食品	2,403,246	29,319,601.20	1.36
3	603799	华友钴业	747,462	26,288,238.54	1.22
4	002594	比亚迪	522,648	25,965,152.64	1.20
5	300078	思创医惠	926,864	24,015,046.24	1.11
6	002570	贝因美	1,700,000	22,304,000.00	1.03
7	600079	人福医药	1,001,305	19,976,034.75	0.93
8	300246	宝莱特	513,052	17,105,153.68	0.79
9	600060	海信电器	800,000	13,696,000.00	0.64
10	000651	格力电器	500,000	12,310,000.00	0.57
11	601997	贵阳银行	775,879	12,243,370.62	0.57
12	300271	华宇软件	701,300	12,237,685.00	0.57
13	000895	双汇发展	583,400	12,210,562.00	0.57
14	002456	欧菲光	350,000	11,998,000.00	0.56
15	300433	蓝思科技	405,000	11,182,050.00	0.52
16	603003	龙宇燃油	682,128	10,968,618.24	0.51
17	600141	兴发集团	700,000	10,647,000.00	0.49
18	000915	山大华特	249,200	10,498,796.00	0.49
19	601689	拓普集团	347,400	10,220,508.00	0.47
20	603117	万林股份	609,385	10,054,852.50	0.47
21	600335	国机汽车	819,361	9,955,236.15	0.46
22	600486	扬农化工	262,841	9,953,788.67	0.46

23	600498	烽火通信	332,900	8,392,409.00	0.39
24	603338	浙江鼎力	158,800	8,275,068.00	0.38
25	300383	光环新网	300,000	7,488,000.00	0.35
26	600827	百联股份	500,000	7,180,000.00	0.33
27	002241	歌尔股份	253,500	6,722,820.00	0.31
28	000997	新大陆	299,918	5,827,406.74	0.27
29	300207	欣旺达	400,000	5,560,000.00	0.26
30	601628	中国人寿	225,000	5,420,250.00	0.25
31	000796	凯撒旅游	330,027	4,999,909.05	0.23
32	300310	宜通世纪	200,000	4,868,000.00	0.23
33	002322	理工环科	200,000	4,772,000.00	0.22
34	600584	长电科技	235,300	4,153,045.00	0.19
35	300408	三环集团	200,000	3,176,000.00	0.15
36	002821	凯莱英	21,409	3,071,977.41	0.14
37	300115	长盈精密	112,680	2,936,440.80	0.14
38	300294	博雅生物	50,000	2,817,500.00	0.13
39	600309	万华化学	124,834	2,687,676.02	0.12
40	603737	三棵树	35,299	2,577,532.98	0.12
41	600882	广泽股份	237,200	2,547,528.00	0.12
42	002510	天汽模	342,807	2,382,508.65	0.11
43	000661	长春高新	20,000	2,237,000.00	0.10
44	600521	华海药业	100,000	2,203,000.00	0.10
45	002475	立讯精密	100,000	2,075,000.00	0.10
46	300336	新文化	76,300	1,499,295.00	0.07
47	002707	众信旅游	87,000	1,352,850.00	0.06
48	300508	维宏股份	10,383	1,261,430.67	0.06
49	603823	百合花	36,764	1,203,653.36	0.06
50	600919	江苏银行	83,962	808,554.06	0.04

51	002530	丰东股份	17,500	564,025.00	0.03
52	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
53	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.01
54	603708	家家悦	5,874	185,794.62	0.01
55	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.01
56	002807	江阴银行	13,466	145,702.12	0.01
57	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
58	300570	太辰光	1,810	100,093.00	0.00
59	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
60	603878	武进不锈	2,000	80,000.00	0.00
61	603928	兴业股份	2,670	74,359.50	0.00
62	603585	苏利股份	1,041	72,578.52	0.00
63	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
64	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
65	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
66	002827	高争民爆	2,059	60,905.22	0.00
67	603033	三维股份	1,160	59,821.20	0.00
68	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
69	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
70	002825	纳尔股份	1,139	53,521.61	0.00
71	603036	如通股份	2,114	51,771.86	0.00
72	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.00
73	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.00
74	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
75	603389	亚振家居	1,963	47,327.93	0.00
76	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
77	603319	湘油泵	721	40,736.50	0.00
78	002828	贝肯能源	1,042	40,221.20	0.00

79	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
80	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
81	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
82	300577	开润股份	500	27,475.00	0.00
83	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
84	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
85	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
86	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
87	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
88	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
89	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
90	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
91	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	601688	华泰证券	176,897,191.74	7.92
2	300413	快乐购	156,935,000.00	7.03
3	300078	思创医惠	130,852,303.50	5.86
4	603799	华友钴业	114,143,342.08	5.11
5	000333	美的集团	109,815,000.00	4.92
6	002500	山西证券	109,428,894.63	4.90
7	002530	丰东股份	77,165,018.92	3.46
8	601689	拓普集团	68,306,738.46	3.06
9	000895	双汇发展	68,129,653.46	3.05

10	002714	牧原股份	55,255,090.00	2.47
11	300496	中科创达	50,437,573.49	2.26
12	600309	万华化学	50,377,367.80	2.26
13	300294	博雅生物	47,451,084.17	2.13
14	002707	众信旅游	46,347,385.77	2.08
15	002216	三全食品	41,132,519.96	1.84
16	300017	网宿科技	38,269,248.77	1.71
17	603005	晶方科技	38,074,852.04	1.71
18	600273	嘉化能源	37,198,316.37	1.67
19	300106	西部牧业	36,223,740.61	1.62
20	300431	暴风集团	35,436,000.00	1.59

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	601688	华泰证券	200,054,121.64	8.96
2	300413	快乐购	163,861,300.03	7.34
3	300078	思创医惠	132,429,771.08	5.93
4	002500	山西证券	116,810,729.72	5.23
5	002714	牧原股份	112,256,320.61	5.03
6	000333	美的集团	111,823,344.83	5.01
7	603799	华友钴业	105,338,704.88	4.72
8	002530	丰东股份	83,039,456.64	3.72
9	600309	万华化学	82,236,906.56	3.68
10	300336	新文化	81,166,188.71	3.64
11	300294	博雅生物	62,962,960.80	2.82
12	000895	双汇发展	58,790,480.80	2.63

13	601689	拓普集团	58,273,947.10	2.61
14	300496	中科创达	48,617,917.54	2.18
15	601801	皖新传媒	48,419,152.19	2.17
16	002707	众信旅游	47,317,803.75	2.12
17	300017	网宿科技	44,304,450.65	1.98
18	603005	晶方科技	39,433,768.68	1.77
19	600273	嘉化能源	38,852,463.30	1.74
20	300327	中颖电子	38,684,970.34	1.73

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	3,198,369,083.11
卖出股票收入（成交）总额	3,234,673,933.65

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	49,935,000.00	2.32
2	央行票据	—	—
3	金融债券	89,302,000.00	4.14
	其中：政策性金融债	89,302,000.00	4.14
4	企业债券	212,643,478.90	9.86
5	企业短期融资券	69,838,000.00	3.24
6	中期票据	147,955,000.00	6.86
7	可转债（可交换债）	927,128,265.04	42.99
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—

10	合计	1,496,801,743.94	69.40
----	----	------------------	-------

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	110032	三一转债	2,223,020	245,688,170.40	11.39
2	132004	15 国盛 EB	2,167,220	214,468,091.20	9.94
3	132006	16 皖新 EB	937,510	106,829,264.50	4.95
4	113008	电气转债	647,940	74,143,774.20	3.44
5	132005	15 国资 EB	588,340	65,305,740.00	3.03

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	497,692.10
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	14,553,288.93
5	应收申购款	716,409.52
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	15,767,390.55

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110032	三一转债	245,688,170.40	11.39
2	132004	15 国盛 EB	214,468,091.20	9.94

3	113008	电气转债	74,143,774.20	3.44
4	132005	15 国资 EB	65,305,740.00	3.03
5	110033	国贸转债	36,070,350.00	1.67
6	113009	广汽转债	34,477,189.20	1.60
7	113010	江南转债	20,791,320.00	0.96
8	132001	14 宝钢 EB	20,184,210.90	0.94
9	123001	蓝标转债	19,315,375.38	0.90
10	132003	15 清控 EB	11,225,260.80	0.52
11	127003	海印转债	9,133,189.62	0.42
12	110031	航信转债	6,894,830.00	0.32
13	128012	辉丰转债	6,176,859.52	0.29
14	128009	歌尔转债	5,874,785.28	0.27
15	117014	15 大族 01	3,696,840.00	0.17

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	002594	比亚迪	25,965,152.64	1.20	非公开发行

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
58,439	34,735.53	24,289,833.19	1.20%	2,005,619,795.63	98.80%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	525,883.35	0.0259%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年5月11日）基金份额总额	3,282,404,810.93
本报告期期初基金份额总额	1,984,975,281.06
本报告期基金总申购份额	555,651,563.58
减:本报告期基金总赎回份额	510,717,215.82

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	2,029,909,628.82

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

2016 年 1 月 13 日起，郑文惠女士担任基金管理人副总经理。

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

（2）报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2015 年起连续 2 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 8 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	2,791,255,045.78	44.04%	2,047,964.47	37.83%	—
光大证券	1	871,929,621.98	13.76%	814,571.63	15.05%	—
中金公司	1	818,599,443.05	12.92%	797,583.57	14.73%	—
中银国际	2	721,059,510.58	11.38%	672,413.30	12.42%	—
中信建投	1	635,490,547.34	10.03%	602,600.80	11.13%	—
国泰君安	1	271,941,207.61	4.29%	257,414.71	4.76%	—
申万宏源	1	227,980,221.29	3.60%	220,389.00	4.07%	—
国元证券	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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	125,865,186.94	8.85%	20,000,000.00	0.22%	—	—
光大证券	62,596,308.87	4.40%	—	—	—	—
中金公司	677,856,864.54	47.67%	5,728,900,000.00	62.35%	—	—
中银国际	21,112,813.14	1.48%	—	—	—	—
中信建投	244,545,804.26	17.20%	3,240,000,000.00	35.26%	—	—

国泰君安	84,518,341.36	5.94%	-	-	-	-
申万宏源	205,470,975.08	14.45%	200,000,000.00	2.18%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2015 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 1 日
2	关于 2016 年 1 月 4 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	关于长期停牌股票（新文化、天龙集团）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 6 日
4	关于 2016 年 1 月 7 日指数发生不可恢复熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 7 日
5	关于旗下部分基金投资山东山水水泥集团有限公司中期票据的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
6	关于公司部分董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 9 日
7	关于长期停牌股票（朗姿股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、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、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、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、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	2016 年 1 月 13 日

		报、公司网站	
12	关于山东山水水泥中期票据估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 13 日
13	关于长期停牌股票（三泰控股）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 15 日
14	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、公司网站	2016 年 1 月 15 日
15	关于长期停牌股票（康得新）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 16 日
16	兴全可转债混合型证券投资基金分红公告（第五十次）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 21 日
17	关于长期停牌股票（万科 A）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 28 日
18	关于参加爱建证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 29 日
19	关于长期停牌股票（青岛海尔）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 1 月 30 日
20	关于调整陆金所资管基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 2 月 15 日
21	关于长期停牌股票（凯撒旅游）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 2 日
22	关于调整旗下基金在江南农商银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 3 日
23	关于调整旗下基金中信银行定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 7 日
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、公司网站	2016 年 3 月 14 日
25	关于长期停牌股票（长安汽车）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 3 月 22 日

26	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 22 日
27	关于增加办理兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式基金转换业务销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 27 日
28	关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 4 月 29 日
29	关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 5 日
30	关于调整诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
31	关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 9 日
32	关于开通网上直销通联支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 11 日
33	关于长期停牌股票（利欧股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 11 日
34	关于旗下部分基金参加民生银行基金通申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 12 日
35	关于长期停牌股票（唐德影视）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 17 日
36	关于调整旗下基金在珠海盈米财富管理有限公司基金定投起点的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 5 月 19 日
37	关于旗下部分基金投资通裕重工（300185）非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 8 日
38	关于长期停牌股票（广电运通）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 15 日
39	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	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 17 日

	的公告		
40	关于调整开放式基金开户证件类型的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 21 日
41	兴全可转债混合型证券投资基金分红公告（第 51 次）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
42	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、公司网站	2016 年 6 月 23 日
43	关于调整众禄金融申购、定投金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 23 日
44	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 6 月 28 日
45	旗下各基金 2016 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 1 日
46	关于调整“通联支付”部分银行卡网上直销申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 5 日
47	关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 15 日
48	关于在工商银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 18 日
49	关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 23 日
50	关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 23 日
51	关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
52	关于旗下部分基金投资比亚迪（002594）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 26 日
53	关于增加中信期货有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 26 日

54	关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
55	关于调整旗下部分基金在指定销售机构的申购、定投、最低赎回、转换转出及最低持有份额限制的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 7 月 29 日
56	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、公司网站	2016 年 8 月 4 日
57	关于旗下基金参加中信证券线上交易平台“信 e 投”基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 11 日
58	关于长期停牌股票（西藏城投）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 16 日
59	关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
60	关于调整旗下基金在长江证券定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 19 日
61	关于调整旗下基金在兴业银行股份有限公司申购及定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 8 月 25 日
62	兴全可转债混合型证券投资基金分红公告（第 52 次）	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 1 日
63	关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 2 日
64	关于调整旗下基金在中信建投证券申购、定期定额申购起点金额及参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 5 日
65	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、公司网站	2016 年 9 月 10 日

66	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 9 月 20 日
67	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、公司网站	2016 年 9 月 30 日
68	关于增加上海华信证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 15 日
69	关于调整旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 10 月 25 日
70	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、公司网站	2016 年 11 月 2 日
71	关于调整旗下基金在和讯信息科技有限公司申购、定期定额申购起点金额及参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 10 日
72	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、公司网站	2016 年 11 月 17 日
73	关于办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 21 日
74	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 22 日
75	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、公司网站	2016 年 11 月 25 日
76	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 11 月 29 日
77	关于开通旗下基金在北京肯特瑞财富投资管理有限公司定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 1 日
78	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、公司网站	2016 年 12 月 2 日

79	关于调整旗下部分基金最低申购、追加申购、定期定额投资金额、及最低赎回、转换转出、持有份额限制的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 12 日
80	关于长期停牌股票（徐工机械）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 14 日
81	关于山东山水水泥中期票据估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 22 日
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、公司网站	2016 年 12 月 22 日
83	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 29 日
84	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、公司网站	2016 年 12 月 30 日
85	关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、公司网站	2016 年 12 月 30 日
86	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、公司网站	2016 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全可转债混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

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

兴全基金管理有限公司

2017 年 3 月 31 日