兴全可转债混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

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

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.4信息披露方式

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

§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

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。

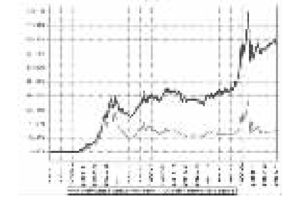
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =80%×(中证可转换债券指数t /中证可转换债券指数t−1−1) +15%×(沪深300指数t /沪深300指数t−1 −1)+5%×(同业存款利率t/360)

Benchmark t =(1+Return t)×(1+Benchmark t−1)−1

其中,t=1,2,3,… T,T表示时间截至日。

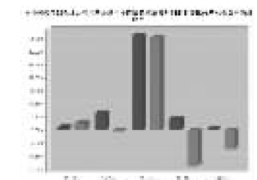
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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



3.3 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。
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遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全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,可转债可能迎来大的扩容,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查。此外,在公司监察稽核部对投研部门实施专项稽核中,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

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
备注	投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文

§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		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		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		–	–
买入返售金融资产		20,000,000.00	–
应收证券清算款		–	38,491,319.67
应收利息		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		–	–
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		–	–
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		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		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		2,029,909,628.82	1,984,975,281.06
未分配利润		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		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		96,922,282.25	583,177,279.36
基金投资收益		–	–
债券投资收益		3,012,578.04	321,963,469.35
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益		–	–
股利收益		4,437,029.40	2,250,330.41
3.公允价值变动收益(损失以"−"号填列)		−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)		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		27,143,263.76	40,275,485.86
2. 托管费		5,219,858.43	7,745,285.77
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		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		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(本期净利润)	–	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(本期净利润)	–	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:

______庄园芳______ ______庄园芳______ ____詹鸿飞____

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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 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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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%

7.4.8.1.2 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%

7.4.8.1.3 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%

7.4.8.1.4 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。

7.4.8.1.5 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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
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。

7.4.8.2.2 基金托管费

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
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。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日					
	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	–	–	–	–	–	–
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日					
	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	–	–	–	–	–

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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。

7.4.9.2 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	–

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 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。

7.4.9.3.2 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。

7.4.10 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前十名股票投资明细

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

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站http://www.xqfunds.com的年度报告正文。

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前十名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

基金合同生效日(2004年5月11日)基金份额总额

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	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴全基金管理有限公司

2017年3月31日