0755-8319520

基金管理人:兴业全球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:2012年3月27日

送出日期;2012年3月27日
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。误导性除述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性本担个别及法需的法律责任。本年度报告上愁二分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。 在实验性本担个别及法需的法律责任。本年度报告上愁二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张约有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月23日复核了本报告中的财务指标。净值表现、基础的允恰局以财务会计报告,投资组合报告等内容、保证复核内容不存企整试法,误与性标选或者重大遗漏。 基金管理人承报以诚实信用,勤勉尽责的原则管理和运用基金符。但不保证基金一定参引。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要推 2.1 基金基本情况		文,投资者欲了解详细内容 §2 基金		舌止文。		
基金简称 兴全		《全合润分级股票				
基金主代码	10	63406				
交易代码		63406				
基金运作方式	1	上市契约型开放式				
基金合同生效日		010年4月22日				
基金管理人		《业全球基金管理有限公司				
基金托管人		3商银行股份有限公司				
报告期末基金份额总	額 1	,580,351,787.66 份				
基金合同存续期		定期				
基金份额上市的证券	交易所溶	3.圳证券交易所				
上市日期		2010-05-31				
		全合润	合润 A		合润 B	
		63406	150016		150017	
		,460,285,937.66 份	48,026,340.00	份	72,039,510.00 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料	青选股票,以追求	K当期收益与3	实现长期资本增值。	
投资策略	过动: 期、济	太跟踪海内外主要经济体	的 GDP、CPI、利 旨标,确定未来市	率等宏观经济 5场变动趋势。	之间进行资产配置。本基金通 指标,以及估值水平、盈利预 本基金通过全面评估上述各 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		基金为股票型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险、 高收益的基金品种。				
2.3 基金管理人和	基金托管人					
项目		基金管理。	基金管理人		基金托管人	
名称		兴业全球基金管理	有限公司	招商	所银行股份有限公司	
	姓名	冯晓莲			张燕	
信息披露负责人	联系电话	021-583689	998		0755-83199084	

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年4月22日-2010年12月31日
本期已实现收益	-115,561,762.85	107,844,378.10
本期利润	-361,319,195.25	201,994,863.08
加权平均基金份额本期利润	-0.2084	0.0778
本期基金份额净值增长率	-20.91%	8.44%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1424	0.0594
期末基金资产净值	1,355,326,409.05	2,226,497,427.52
期末基金份额净值	0.8576	1.0844
注・1. 上述财务指标采用的计算/	寸, 详见中国证券监督管理委员	员会发布的 (证券投资基金信息披露编报规则第1号<

实现部分的教感数。 1. 达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 独责等, 计大费用压实际成益;冲罗服干所列数字。 4. 本基金的基金合同于 2010 年 4 月 22 日起生效。 3. 基金岭值表脚

3.2.1 基金份		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	-5.29%	1.35%	-6.48%	1.12%	1.19%	0.23%
过去六个月	-14.97%	1.26%	-17.83%	1.08%	2.86%	0.18%
过去一年	-20.91%	1.23%	-19.24%	1.04%	-1.67%	0.19%
自基金合同生效 起至今	-14.24%	1.25%	-21.19%	1.16%	6.95%	0.09%
注:本基金业	绩比较基准为:80 债指数且有较强					基于如下考虑:沪沟



可生象以未基金行字母值者长本及具与同期非损比较基准收益率的对比图

注:2010年数据统计期间为2010年4月22日 磁盘合同生效日 至2010年12月31日,数据被实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。 8条年度进行折算。 3.3 过去三年基金的利润分配情况 根据本基金基金台间的约定,本基金不进行收益分配,运作期内也不单独对台河 A 份额与合河 B 份额进行收益分配。 8.4 管理人报告

姓名	职务	仕本基金的基金约	理 助理 期限	证券从业年限	35EE
XEA	RF(95	任职日期	离任日期	III.97/MAE-1-PIX	100.97
张惠萍	本基金基金经理	2010年4月22日	_	9年	1976年生、经济学硕士、2002年6月加入兴业基金管理有限公司 磅),历任兴业基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金 LOF 基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金 LOF)基金经理。
王海涛	基金管理部总监 助理、本基金基 金经理	2010年 5 月 25 日	-	8年	1972年生,沃頓商学院 MBA、历任 DEC 中国 有限公司工程师,中国惠普沈阳分公司部门 经理、北京百特赛威计算机网络有限公司总 经理、美国 Business Excellence Inc.投资经理, 建根土丹利亚洲有限公司全球财富管理部副 总裁。
		期末的职务 假告期			报告期内离任的)。
			立时即担任基金	対経理)或公司作	:出聘任决定之日 (基金成立后担任基金经理)
离仕日期	旨公司作出解聘は	足之日。			

本核古物"小·香墨·马克"、"等规定,从货货决策,交易执行。业绩评估等环节严格把失,绷体合权区组百之四四至为人。" "等据定,从货税投入"研究分析,投资决策,交易执行。业绩评估等环节严格把失,绷体合权区组百之四四至为人。" "该者的合法权益" 43. 本块设置合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较目前。未基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合,暂无法对本基金的投资业绩进行比较。 43.3 异常交易行为的专项通明 平安易和利益输送的异常交易情况。 44. 音型人对推告测内基金投资现路和业绩表现的规则,本核告期内,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。 44. 音型人对推告测内基金投资现象和业绩表现的规则 44. 报告测内基金投资现象和运费表现的发现,从为 2011 年是 防宁决定成败"的一年,及时止盈与及时止损罪违案。但是,在定定公司1年中间过失来看时,发现市场的惨烈程度是是远远超出了年初的规则,指数的"跌粮度在全球基金公别前"来是个股的疾患在近全遗传的现象的发生,而且有能来越渡边缘化的遗传》从极失上来说,食品全名列前,来是小股的疾患是近远域的发生的遗传,从我生来看代,食品水料板大规是是今年超额收益最大的两个板块,跌得较多的是创业版和中小板的介数和钢铁,有色、电子、机械设备、信息设备的大规模。

财务报表是否经过审计 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:兴全合润分级股票型证券投资基金 报告截止日: 2011年 12 月 31 日

75 C F F F F F F F F F F F F F F F F F F	77.51		单位:人民币
资产	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		65,989,895.49	30,277,877.46
结算备付金		6,332,773.37	9,716,634.34
存出保证金		1,646,960.01	5,624,464.46
交易性金融资产		1,308,596,054.06	1,814,916,203.08
其中:股票投资		1,136,214,908.26	1,707,589,203.08
基金投资		_	-
债券投资		172,381,145.80	107,327,000.00
资产支持证券投资		-	_
衍生金融资产		_	-
买人返售金融资产		_	-
应收证券清算款		_	75,146,937.79
应收利息		2,616,273.69	1,270,496.99
应收股利		-	_
应收申购款		293,684.69	300,848,607.63
16677 CC 4FL CAUSe ->-			

兴全合润分级股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年 12月 31日

其他资产		-	
资产总计		1,385,475,641.31	2,237,801,221.7
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		_	
交易性金融负债		_	
汀生金融负债		_	
卖出回购金融资产款		_	
应付证券清算款		23,609,319.79	
立付赎回款		524,992.99	1,325,173.1
立付管理人报酬		1,784,415.96	2,574,508.3
应付托管费		297,402.64	429,084.7
应付销售服务费		_	
应付交易费用		2,581,250.15	5,620,033.6
立交税费		_	
立付利息		_	
立付利润		_	
递延所得税负债		_	
其他负债		1,351,850.73	1,354,994.3
负债合计		30,149,232.26	11,303,794.2
听有者权益:			
实收基金		1,580,351,787.66	2,053,261,417.4
未分配利润		-225,025,378.61	173,236,010.0
听有者权益合计		1,355,326,409.05	2,226,497,427.5
负债和所有者权益总计		1,385,475,641.31	2,237,801,221.7

在:1.(水台版止日 2011年 12 月 31日.基金份額率值 0.8576 元.基金份額高厲为1.580.351 787.66 份.其中:合润基金份額等值 0.8576 元.投金份額を適用 1.850.351 787.66 份.其中:合润基金份額等荷値 0.8577 元.份額总額 1.460.285,937.66 份.台酒 A 基金份额参考净值 0.0607元.份額总額 18,026.340.00 份;合酒 B 基金份额参考净值 0.7627元.份额总额 72.039,510.00 份。 2.本基金份面子2010年 4月 22 日生安、上牛皮可比期间自 2010年 4月 22 日至 2010年 12 月 31 日。 2.2 本版金份面子2010年 4月 22 日生安、上牛皮可比期间自 2010年 4月 22 日至 2010年 12 月 31 日。 会计主体、兴全合涵分级影響刑派选择以来中人

			单位:人民币
		本期	上年度可比期间
项目	附注号	2011年1月1日至2011年12	
		月 31 日	12月31日
一、收入		-303,363,657.28	269,875,920.84
1.利息收入		4,666,043.78	6,178,265.25
其中:存款利息收入		999,652.37	3,520,124.13
债券利息收入		3,443,389.83	1,912,985.59
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收人		223,001.58	745,155.53
其他利息收入		-	
2.投资收益(假失以""填列)		-63,451,202.69	166,727,384.04
其中:股票投资收益		-70,575,585.76	150,847,269.00
基金投资收益		-	
债券投资收益		-155,132.81	7,469,558.6
资产支持证券投资收益		-	
衍生工具收益		-	
投利收益		7,279,515.88	8,410,556.4
3.公允价值变动收益(损失以""号填列)		-245,757,432.40	94,150,484.9
4.汇兑收益 假失以 ""号填列)		-	
5.其他收入 假失以 ""号填列)		1,178,934.03	2,819,786.5
咸;二、费用		57,955,537.97	67,881,057.7
1.管理人报酬		26,469,520.68	27,400,960.8
2.托管费		4,411,586.77	4,566,826.8
3.销售服务费		-	
4.交易费用		26,415,611.45	34,931,040.5
5.利息支出		160,911.86	523,947.9
其中:卖出回购金融资产支出		160,911.86	523,947.9
6.其他费用		497,907.21	458,281.4
三、利润总额(亏损总额以""号填列)		-361,319,195.25	201,994,863.08
咸:所得税费用		_	
	1	-361,319,195.25	201,994,863.08

45区日初1:2011 〒 1 77 1 日 至	2011 + 12 /1 31 🖂		单位:人民币元
		本期	
项目		年1月1日至2011年12月31	
	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)	2,053,261,417.44	173,236,010.08	2,226,497,427.52
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数 (本期利润)	-	-361,319,195.25	-361,319,195.25
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数 (净值减少以""号填列)	-472,909,629.78	-36,942,193.44	-509,851,823.22
其中:1.基金申购款	486,698,676.33	15,616,017.19	502,314,693.52
2.基金赎回款	-959,608,306.11	-52,558,210.63	-1,012,166,516.74
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 儘金净值)	1,580,351,787.66	-225,025,378.61	1,355,326,409.05
项目		上年度可比期间 年 4 月 22 日至 2010 年 12 月 31	
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 煁金净值)	3,328,967,444.30	-	3,328,967,444.30
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	201,994,863.08	201,994,863.08
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)	-1,275,706,026.86	-28,758,853.00	-1,304,464,879.86
其中:1.基金申购款	800,385,902.17	65,664,397.49	866,050,299.66
2.基金赎回款	-2,076,091,929.03	-94,423,250.49	-2,170,515,179.52
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动(争值 减少以""号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 偡金净值)	2,053,261,417.44	173,236,010.08	2,226,497,427.52
报表附注为财务报表的组成部			

7.4.2 会计报表的编制基础 未对各报表系按照十国的政府 2006年2月原作的 企业会计准则一基本准则和 38 項具体会计准则,其后颁布的应用 海解科及表示按照十国的政府 2006年2月原作的 企业会计准则"编制,同时,对于在具体会计传算和信息披露方面,也参考了中国正 协会制定的 但参校陈基金会计体要单分指引,中国正空会神理的 依于进一场视时递转发基金估值业务的指导差 6年 市业务投资基金会计企业分计准则分值但业务及停缩的值计价有关事项的通知,还参校资基金信息披露管理办 6年 市业务投资基金信息披露汽车会业会计准则对自己的发展。10 全球投资基金信息披露管理办 但券投资基金信息披露汽车会和发展,10 全球投资基金信息披露等和的基础为,但参校资基金信息披露路根规则第3号 相表榜样出的编制及披露》,征券投资基金信息披露 XBRI 模板第3号<年度报告和半年度报告》及其他中国证监会领相关规则

调整为 [Kei 整国易条批准。财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起、调整由出让力按证券 假票)交易印花税税率缴 纳印花税、受让方不再成化、税率不变; 根调解核高、国家原总总局财税字 2005 [103 号文 铁于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知]的规定,股权分置 改革过程中国非流通股股东向流通股股东交付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。 2 當业税、企业所得税

《馬亚松·亚里斯博教 相關財務部 国家院务島局財稅字 2004 78 号文 长于证券投资基金税收款策約適知約规定。自2004 年 1 月 1 日起,对投资基金 針闭式证券投资基金 并放式证券投资基金 管理人运用基金买卖股票,债券的差价收入,继续免征营业税和所得税。 企业所停保: 根据财政部、国家税务总局财税字 2005 1103 号文 铁于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知)的规定、股权分置 改革中非流通般股东通过对价方式向流通跟股东支付的股份、现金等收入、暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

证券股份有限公司(以下简称"兴业证券") 全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V 基金管理人的股东 上以下英雄交易均在正常业务范围内经面的商品、V) 上以下英雄交易均在正常业务范围内经一般商业条款订立。 7.4.8 1 超过关联方交易单元进行的交易 7.4.8.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本 2011年1月1日至2		上年度 2010年 4 月 22 日	で可比期间 至 2010 年 12 月 31 日
大联刀石桥	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	5,442,120,258.96	28.71%	12,645,969,780.45	50.81%
7.4.8.1.2 债券	· 交易			金额单位:人民币元
关联方名称	本 2011年1月1日至		上年度 2010年 4 月 22 日	「可比期间 至 2010 年 12 月 31 日
大呎月石州	成交金額	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	50,498,803.50	40.54%	-	-

7.4.8.1.3 债券回购交易 金额单位:人民币元 上年度可比期间 2010年 4 月 22 日至 2010 年 12 月 31 日 2011年1月1日至2011年12月31日 占当期债券回购 成交总额的比例 回购成交金额 回购成交金额

7.48.1.4 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。 7.48.1.5 应支付关联方的佣金

\(\frac{1}{2}\)		2011年1月1日	本期 至 2011 年 12 月 31 日		
关联方名称	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	4,548,840.95	34.59%	1,134,027.06	43.94%	
关联方名称	上年度可比期间 2010年 4 月 22 日至 2010 年 12 月 31 日				
X4X77 4241V	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	10,530,598.13	57.42%	1,447,081.95	25.76%	
注:上述佣金 证管费等)。管理 7.4.8.2 关联 7.4.8.2.1 基		司需承担的费用 主要包括:为本基	包括但不限于买 读)经手费、证法 金提供的证券投资研究成果和市	幹结算风险基金和买 (:场信息服务。	

		单位:人民币元
项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31 日	上年度可比期间 2010年4月22日至2010年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	26,469,520.68	27,400,960.86
其中:支付销售机构的客户维护费	6,386,634.16	9,171,475.04
注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50 验资产净值×1.50%当年天数。	%的年费率计提。计算方法如下:每日后	z支付的基金管理费=前一日的基

本期 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31 2010年4月22日至2010年12 4,411,586.77 当期发生的基金应支付的托管费 违法金托管股按前一日的基金资产净值的0.25%的年度率计提。计算方法如下,每日应支付的基金托管费=前一 金资产净值、0.25%治年天发。 7.48.3 与关联方进行辖行间周业市场的债券 绘回购)这易 本基金本银告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间周业市场的债券 绘回购)交易。 7.48.4 各关联方投资本基金的情况

项目	本期 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年4月22日至2010年 12月31日
基金合同生效日(2010年4月22日)持有的基金份额	-	13,004,460.00
期初持有的基金份额	13,004,460.00	-
期间申购买人总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	13,004,460.00	13,004,460.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.82%	0.63%

3.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7.4.8.4.2 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

2、兴业证券 7.4.8.5 由关	本报告期末及上年度未 联方保管的银行存款。	E持有的基金份额均为合治 余额及当期产生的利息收/	基础份额。	单位:人民币元
关联方 名称	2011年1月1日	本期 至 2011 年 12 月 31 日	上年度可 2010年 4 月 22 日至 2	
4040	期末余额	当期利息收入	期末余額	当期利息收入
招商組行	65 989 895 49	832 736.41	30 277 877 46	3 382 538 04

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内直接购人关联方承销证券。 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4	1.9 期末 1.9.1 因认	购新发/增发证	31 日)本基金 券而于期末持有	持有的流通受限证 有的流通受限证券	券			:	金额单位:人	民币元
	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 単位:股)	期末 成本总額	期末估值总额	备注
002055	得润电子	2011年3月10日	2012年3月12日	非公开发行流通受限	21.00	19.80	2,000,000	42,000,000.00	39,600,000.00	-
600187	国中水务	2011年2月16日	2012年2月17日	非公开发行流通受限	7.50	9.73	3,500,000	26,250,000.00	34,055,000.00	-
600546	山煤国际	2011年12月5日	2012年12月1日	非公开发行流通受限	22.80	22.92	1,000,000	22,800,000.00	22,920,000.00	-
002259	升达林业	2011年1月12日	2012年1月13日	非公开发行流通受限	5.67	3.04	2,000,000	11,340,000.00	6,080,000.00	-
002259	升达林业	2011年9月23日	2012年1月13日	非公开发行转赠	-	3.04	1,600,000	-	4,864,000.00	-
601555		2011年12月6日	2012年3月12日	认购新发证券	6.50	6.57	316,553	2,057,594.50	2,079,753.21	-
注	:本基金	寺有的非公开发	行股票升达林	业,于 2011 年 9 月	23 日	实施半年	年度权益分	派方案,以资本	公积金向全	体股东

注:本基金特有的非公开发行股票升达林业。于 2011年9月23日实施半等10 B奘特等股、本基金新图 1.600.000 股. 不适合需用 1.600.000 股. 不适合需用 1.600.000 股. 不适合,不适合,不可能是有多数。 1.49.2 期末持有的智时停榨等流通受限股票。 1.49.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 1.49.3.1 银行间市场债券正回购 4.基金本投售期末未持有解释(印间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。 1.49.3.2 交易所市场债券正回购 4.基金本促出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 无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

8.2 期末按行业分类的股票投资组 代码 A 农、林、牧、渔业

В	采掘业	39,419,879.00	2.91
C	制造业	672,099,856.12	49.59
CO	食品、饮料	131,010,963.53	9.67
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	10,944,000.00	0.81
C3	造纸、印刷	_	_
C4	石油、化学、塑胶、塑料	71,534,484.30	5.28
C5	电子	86,901,636.15	6.41
C6	金属、非金属	47,280,741.30	3.49
C7	机械、设备、仪表	88,011,442.05	6.49
C8	医药、生物制品	236,416,588.79	17.44
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	44,392,802.00	3.28
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	23,016.00	0.00
G	信息技术业	139,916,744.95	10.32
H	批发和零售贸易	7,846,234.20	0.58
I	金融、保险业	9,094,836.81	0.67
J	房地产业	187,438,454.63	13.83
K	社会服务业	4,749,224.55	0.35
L	传播与文化产业	31,233,860.00	2.30
M	综合类	_	-
	合计	1,136,214,908.26	83.83
	期末按公允价值占基金资产净值比例		会额单位 J.E.

					3匹18(十つに:)/ひくロン
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	600208	新湖中宝	33,215,721	113,597,765.82	8.38
2	002020	京新药业	5,388,568	91,336,227.60	6.74
3	600376	首开股份	7,699,759	73,840,688.81	5.45
4	600779	水井坊	2,563,380	53,984,782.80	3.98
5	300101	国腾电子	1,610,525	50,812,063.75	3.75
6	600529	山东药玻	3,834,610	47,280,741.30	3.49
7	000661	长春高新	1,200,301	42,010,535.00	3.10
8	002055	得润电子	2,000,000	39,600,000.00	2.92
9	000800	一汽轿车	3,999,953	35,399,584.05	2.61
10	600187	国中水务	3,500,000	34,055,000.00	2.51
注:投	资者欲了解本持	设告期末基金投	资的所有股票明细,应阅读	英登载于本公司网站 http	:/www.xyfunds.com.cn 的年度报告
ψ·.					

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 8.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

3	600383	金地集团	213,031,301.97	9.57
4	600497	驰宏锌锗	210,796,805.64	9.47
5	601318	中国平安	210,789,482.04	9.47
6	600376	首开股份	209,735,225.95	9.42
7	600068	葛洲坝	188,905,992.26	8.48
8	600426	华鲁恒升	172,680,943.08	7.76
9	600015	半宣臣/1 华夏银行	133,241,132.53	5.98
10				5.89
	600030	中信证券	131,137,604.82	
11	000895	双汇发展	119,232,889.99	5.36
12	002060	粤水电	115,724,739.43	5.20
13	601088	中国神华	109,411,917.70	4.91
14	600502	安徽水利	108,484,802.02	4.87
15	600795	国电电力	103,106,858.06	4.63
16	600362	江西铜业	101,527,865.83	4.56
17	600519	贵州茅台	98,260,825.72	4.41
18	300136	信维通信	93,687,077.89	4.21
19	000069	华侨城 A	92,412,135.92	4.15
20	000063	中兴通讯	92,023,569.64	4.13
21	601601	中国太保	88,760,708.64	3,99
22	000800	一汽轿车	87,526,792.03	3.93
23	601766	中国南车	85,874,598.88	3.86
24	601166	兴业银行	85,222,437,48	3.83
25				3.83
	600585	海螺水泥	83,477,508.27	
26	002244	浜江集团	82,794,351.25	3.72
27	600143	金发科技	82,049,099.86	3.69
28	000661	长春高新	76,747,945.63	3.45
29	600449	宁夏建材	76,644,600.07	3.44
30	600170	上海建工	75,038,159.18	3.37
31	601818	光大银行	71,695,104.81	3.22
32	600079	人福医药	70,621,419.67	3.17
33	300101	国勝电子	70,196,871.12	3.15
34	600169	太原重工	67,870,713.76	3.05
35	600663	陆家嘴	67,750,270.28	3.04
36	600187	国中水务	66,426,878.11	2.98
37	000858	五粮液	63,921,559.94	2.87
38	002142	宁波银行	63,409,887.49	2.85
39	601111	中国国航	62,084,722.41	2.79
40	000002	万科A	61,922,968.35	2.79
41				
	000983	西山煤电	61,148,162.18	2.75
42	600276	恒瑞医药	60,743,238.81	2.73
43	000006	深振业 A	59,912,716.33	2.69
44	600750	江中药业	59,603,872.99	2.68
45	600529	山东药玻	59,235,159.26	2.66
46	600779	水井坊	57,275,242.03	2.57
47	000024	招商地产	57,082,080.30	2.56
48	600123	兰花科创	55,368,177.85	2.49
49	000998	隆平高科	52,975,409.93	2.38
50	000880	潍柴重机	52,440,849.15	2.36
51	601699	潞安环能	52,348,505.53	2.35
52	000825	太钢不锈	51,899,513.09	2.33
53	600019	宝钢股份	51,550,054.36	2.32
54	601808	中海油服	51,063,399.25	2.29
		左 东阿阿胶		2.29
55	000423		49,756,088.06	
56	002506	超日太阳	49,106,721.59	2.21
57	600195	中牧股份	48,738,376.95	2.19
58	600332	广州药业	48,656,880.76	2.19
59	601390	中国中铁	48,180,400.92	2.16
60	000039	中集集团	47,770,001.67	2.15
61	600320	振华重工	47,458,891.47	2.13
62	002250	联化科技	47,272,947.94	2.12
63	600348	阳泉煤业	46,768,508.95	2.10
64	600050	中国联通	46,550,144.73	2.09
65	600690	青岛海尔	45,560,000.73	2.05
66	600309	烟台万华	45,543,232.60	2.05
67	300137	先河环保	45,241,524.82	2.03
37	601666	平煤股份	44,847,226.76	2.03
68				

应付佣金总额				.,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		金额单位:人民币
的比例		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 %)
43.94%		1	600048	保利地产	368,358,998.82	16.5
		2	600376	首开股份	237,842,069.38	10.6
		3	600143	金发科技	217,622,652.37	9.7
应付佣金总额		4	601318	中国平安	215,054,069.22	9.6
的比例		5	600068	葛洲坝	212,829,490.24	9.5
		6	600208	新湖中宝	207,631,832.72	9.3
25.76%		7	600497	驰宏锌锗	205,403,383.49	9.2
U险基金和买 Ø	į)	8	600383	金地集团	203,505,344.86	9.1-
服务。		9	600426	华鲁恒升	177,785,242.81	7.9
		10	000895	双汇发展	144,309,153.48	6.4
单位:人民币	77	11	601766	中国南车	138,534,887.41	6.2
比期间	ĩ	12	600030	中信证券	136,353,592.16	6.1
日至 2010 年 12		13	600015	华夏银行	128,970,523.12	5.7
1日		14	600585	海螺水泥	110,335,759.82	4.9
27,400,960.86	1	15	601088	中国神华	110,014,403.70	4.9
	-	16	600502	安徽水利	107,629,514.85	4.8
9,171,475.04		17	002244	滨江集团	103,207,041.32	4.6
理费=前一日的	基	18	002060	粤水电	102,697,662.75	4.6
		19	000002	万科A	102,631,296.24	4.6
单位:人民币	元	20	600362	江西铜业	101,557,475.85	4.5

21	000063	中兴通讯	100,030,369.40	4.49
22	600795	国电电力	95,386,249.95	4.28
23	000069	华侨城 A	94,659,373.08	4.25
24	600449	宁夏建材	86,969,890.86	3.91
25	600067	冠城大通	85,706,901.75	3.85
26	601601	中国太保	85,438,550.99	3.84
27	300101	国腾电子	84,422,670.33	3.79
28	600170	上海建工	83,934,183.29	3.77
29	601166	兴业银行	82,542,982.78	3.71
30	000983	西山煤电	81,712,636.76	3.67
31	600519	贵州茅台	77,176,191.33	3.47
32	600169	太原重工	76,549,547.24	3.44
33	600029	南方航空	74,879,407.41	3.36
34	000592	中福实业	69,745,689.81	3.13
35	600663	陆家嘴	67,450,414.91	3.03
36	601818	光大银行	67,188,848.55	3.02
37	002142	宁波银行	64,981,314.67	2.92
38	000858	五粮液	63,589,611.14	2.86
39	601111	中国国航	62,084,534.71	2.79
40	600750	江中药业	60,572,472.20	2.72
41	600261	阳光照明	59,580,044.88	2.68
42	000024	招商地产	59,506,497.13	2.67
43	000880	潍柴重机	58,562,804.77	2.63
44	600123	兰花科创	57,986,917.70	2.60
45	600160	巨化股份	57,914,939.05	2.60
46	600320	振华重工	55,051,946.62	2.47
47	000006	深振业 A	54,364,932.51	2.44
48	601699	潞安环能	54,327,461.43	2.44
49	000039	中集集团	53,908,543.79	2.42
50	000998	隆平高科	53,790,563.01	2.42
51	002449	国星光电	53,026,492.41	2.38
52	600395	盘江股份	52,109,674.07	2.34
53	000825	太钢不锈	49,167,714.30	2.21
54	600019	宝钢股份	48,579,096.72	2.18
55	601808	中海油服	48,250,688.54	2.17
56	600690	青岛海尔	48,041,403.31	2.16
57	600332	广州药业	47,566,459.17	2.14
58	002506	超日太阳	46,939,920.28	2.11
59	000651	格力电器	46,414,498.89	2.08
60	601390	中国中铁	46,403,540.45	2.08
61	600348	阳泉煤业	46,062,543.89	2.07
62	002155	辰州矿业	45,418,671.66	2.04

注: 实人股票成本"、爽出股票收入"按买卖成交金额 钺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 9,665,603,088.98

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	_
2	央行票据	87,057,000.00	6.42
3	金融债券	-	_
	其中:政策性金融债	-	_
4	企业债券	14,396,200.00	1.06
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	_
7	可转债	70,927,945.80	5.23
8	其他	-	_
9	合计	172,381,145.80	12.72
8.6 期	末按公允价值占基金资产净值比例为	小排名的前五名债券投资明细	
			会额单位, 人民币元

11央票 28 1101028 87,057,000.0 33,739,245.80

8.9.1 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

单位:人民币元 1,646,960.01 4,556,918.3

金额单位:人民币 金额单位:人民币 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值 流通受限情况说明 1 002055 得润电子 2 600187 国中水务

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

						份额单位:
				持有	f人结构	
份额级别	持有人户	户均持有的基金	机构投资者		个人投资者	
(31)(602.33	数(户)	份额	持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
兴全合润	21,522	67,850.85	430,875,135.06	29.51%	1,029,410,802.60	70.49%
合润 A	1,159	41,437.74	459,712,472.06	9.43%	43,496,929.00	90.57%
合润 B	1,330	54,165.05	24,307,926.00	33.74%	47,731,584.00	66.26%
合计	24,011	163,453.63	459,712,472.06	29.09%	1,120,639,315.60	70.91%
注,对下屋	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	采用下屋分级基金份额的。	今计数 (即期)

基金份额总数)。 9.2 期末上市基金前十名持有人

カケ	11/1	八石你	1寸目1万砂(07)	<u> </u>	드 [] 조() 가겠다[)]
1	任春美		3,349,525.00		6.97
2	徐勇群		2,673,655.00		5.579
3	中国银河证券股份有限公司	司	1,618,400.00		3.379
4	田忠毅		1,196,810.00		2.49
5	东证资管-中行-东方红基:	金宝集合资产管理计划	1,142,500.00		2.389
6	夏娜华		1,138,234.00		2.37
7	上海固德资产管理有限公司	司	1,130,000.00		2.35
8	翁秀枝 本立		1,050,900.00		2.199
10	李宇高永		916,425.00		2.089
合润1			916,425.00		1.919
序号	持有力	名称	持有份额(份)	占.	上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公	司分红账户	17,130,772.00		23.789
2	交银康联人寿保险有限公	司	3,123,916.00		4.349
3	中国银河证券股份有限公	司	2,427,600.00		3.379
4	张国荣		1,892,389.00		2.639
5	王哲		1,410,300.00		1.969
6	毛永华		1,282,590.00		1.789
7	张训苏		1,060,472.00		1.479
8	中国人寿保险股份有限公	司	1,005,638.00		1.409
9	毛福生		957,200.00		1.339
10	李严		863,800.00		1.209
9.3 期	末基金管理人的从业人员持	持有本开放式基金的情况	·		
	项目	份额级别	持有份额总数 (分)	占基金总份额比例
		兴全合润	530	0,957.60	0.03649
基金管理	E公司所有从业人员持有本	合润 A		-	
1	开放式基金	会润 R			

项目	兴全合润	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	1,931,480,237.44	48,712,472.00	73,068,708.00
本报告期基金总申购份额	674,151,246.33	74,294,896.00	111,442,344.00
减:本报告期基金总赎回份额	1,145,345,546.11	74,981,028.00	112,471,542.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,460,285,937.66	48,026,340.00	72,039,510.00
注:本期申购含转换转人份额,配对转换转, 约本期申购,即配对转换人份额)之和等于兴全台 页)之和等于兴全合润分级股票配对转换人份额。	润分级股票配对转换出伤		

11.1 基金份额持有人大会决议

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 基金投资额略的改变 报告期内本基金投资策略未发生改变。

	交易单元	股票3	と 易	应支付该差	育的佣金	
券商名称	数量	成交金額	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
兴业证券	2	5,442,120,258.96	28.71%	4,548,840.95	34.59%	-
国泰君安	2	5,211,364,855.83	27.49%	3,320,402.34	25.25%	-
东方证券	1	3,421,629,545.33	18.05%	2,224,044.97	16.91%	-
国信证券	1	1,761,649,080.65	9.29%	1,079,017.45	8.20%	-
中信证券	1	1,297,806,030.82	6.85%	843,568.95	6.41%	-
安信证券	2	1,137,114,300.87	6.00%	696,489.65	5.30%	-
银河证券	1	537,886,468.68	2.84%	349,624.46	2.66%	-
德邦证券	2	145,884,960.74	0.77%	89,355.36	0.68%	-

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
券商名称	债券交易		债券回购交易	
	成交金額	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
兴业证券	50,498,803.50	40.54%	-	
国泰君安	35,303,393.82	28.34%	480,000,000.00	100.00
东方证券	33,308,693.00	26.74%	-	
国信证券	-	-	-	
中信证券	-	-	-	
安信证券	-	-	-	
银河证券	5,462,137.00	4.38%	-	
德邦证券	-	-	-	
	§-	12 影响投资者决策的其他国	重要信息	