兴全合润分级股票型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

2013年6月30日

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月28日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2013年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全合润分级股票		
基金场内简称	兴全合润		
基金主代码	163406		
基金运作方式	上市契约型开放式		
基金合同生效日	2010年4月22日		
基金管理人	兴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		
报告期末基金份额总额	1,057,669,107.51份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	2010-05-31		
下属分级基金的基金简称	兴全合润分级股票	合润A	合润B
下属分级基金的交易代码	163406	150016	150017
报告期末下属分级基金份额总额	996,559,931.51份	24,443,670.00份	36,665,506.00份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过定量与定性相结合精选股票,以追求当期收益与实现长期资本增值。		
投资策略	本基金以定性与定量研究相结合,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。		
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证国债指数		
风险收益特征	本基金为股票型基金产品,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、较高收益的基金品种。		
下属三级基金的风险收益特征	从基金份额整体运作来看,本基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于高风险、高收益的股票型基金品种,其风险收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	根据本基金合润A份额与合润B份额的关系约定,合润A份额将表现出低风险、预期收益较低的风险收益特征。	根据本基金合润A份额与合润B份额的关系约定,合润B份额在合润基金份额净值在一定区间内具有一定的杠杆性,因此,表现出比一般股票型份额更高的风险特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099,021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 – 2013年6月30日)
本期已实现收益	209,337,803.49
本期利润	142,486,483.13
加权平均基金份额本期利润	0.1312
本期基金份额净值增长率	14.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0069
期末基金资产净值	1,071,873,312.97
期末基金份额净值	1.0134

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.20%	1.30%	-12.66%	1.50%	6.46%	-0.20%
过去三个月	3.35%	1.01%	-9.29%	1.16%	12.64%	-0.15%
过去六个月	14.20%	1.11%	-9.85%	1.20%	24.05%	-0.09%
过去一年	14.96%	1.23%	-7.89%	1.09%	22.85%	0.14%
过去三年	9.20%	1.28%	-8.83%	1.10%	18.03%	0.18%
自基金合同生效起至今	0.68%	1.26%	-24.04%	1.13%	24.72%	0.13%

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

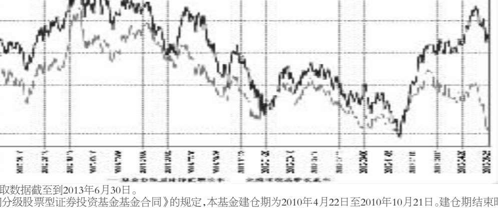
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

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

$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times (1 + Benchmark_{t-1}) - 1$

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2013年6月30日。

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业全球基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本公司")是经证监基金字[2003] 100 号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月2日,中国证监会批准(证监许可[2008]6号)了公司股权变更申请,全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后,兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%,全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。同时公司名称由"兴业基金管理有限公司"更名为"兴业全球人寿基金管理有限公司",公司注册资本由9800万元变更为1.2亿元人民币。2008年7月7日,经中国证监会批准(证监许可[2008]888号文),公司名称由"兴业全球人寿基金管理有限公司"变更为"兴业全球基金管理有限公司",同时,公司注册资本由人民币1.2亿元变更为人民币1.5亿元人民币,其中两股东出资比例不变。

截止2013年6月30日,公司旗下管理着十三只基金,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、兴全社会责任股票型证券投资基金、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、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢治宇	本基金基金经理	2013年1月29日	-	5年	1981年生,经济学硕士,2007年加入兴业全球基金管理有限公司,历任行业研究员、专户投资部任投资经理。
张惠萍	-	2010年4月22日	2013年2月7日	-	-

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

股票市场在今年上半年出现大幅分化。一方面,经济增长和企业盈利的状况开始低于市场预期,特别是市场年初对于经济刺激的预期破灭之后,开始预期经济转型,周期类行业大幅下跌,与经济转型相关的传媒、计算机、通信设备等小市值行业上涨。

今年上半年市场分化较为显著的主要原因包括了几个主要的原因,首先整体资金面并不宽裕的情况下资金有集中的需求,特别是今年融资额显著增大,这部分资金是今年市场重要的增量资金;其次是市场对转型预期的强化到了较为极致的程度,导致风格显著的偏移到成长股的方向。

合润基金在今年上半年保持较低仓位,配置相对平衡,减持了部分前期涨幅较大的电子、通讯设备等股票,继续持有估值较低的大市值股票。

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14.20%,同期业绩比较基准收益率-9.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

过去四个季度中,我们看到了银行表外信贷的大规模释放,其中有经过信托贷款、委托贷款等能够统计在社会融资总量中的资金,也有在银行同业资产项下或者并未体现在银行资产账上的其它隐性的信贷投放。根据《中国金融稳定报告2013》,截止2012年末银行表外业务规模48.65万亿,同比增长19.68%,相当于表内资产36.31%。

对庞大的影子银行构成威胁的是不稳定的利率水平,这是未来最需要关注的问题。一旦银行出现了去杠杆的行为,将对整个金融系统和经济增长构成威胁。可能出现的征兆包括:1、高杠杆的信托行业出现违约。2、银行表外业务的规模增速放缓。3、债券市场融资规模缩减。4、银行间拆借利率在9月末、11月份-12月份由于季节效应再度出现攀升。

市场向上超预期的风险取决于政府对冲经济下滑的意愿和能力,政府目前的思路是"盘活存量、调整经济结构"的思路,但保证社会融资总量稳定和投资稳定的思路实难两全。

今年下半年发生的最可能情况应该还是政府保证基本的投资量,维持经济增速稳定,估计下半年既不会看到经济的迅速下滑,也很难看到经济有大起色;同时转型仍将会是一个漫长的过程,难以看到一蹴而就的成功。

就行业而言,相对看好大银行、铁路、汽车、家电、饮料、医药等增长稳定的股票,同时关注行业基本面出现拐点的光伏等板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程,选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议,并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后,由IT人员或IT人员协助估值人员在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给估值造成影响的因素,并就可能带来的影响提出建议和意见;5、监察稽核人员参与估值方案的制定,确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定,定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查,确保估值委员会决议的有效执行,负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:兴全合润分级股票型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		77,921,067.18	55,799,779.07
结算备付金		1,440,167.87	2,994,665.24
存出保证金		2,319,050.10	1,500,000.00
交易性金融资产		913,291,261.11	930,240,888.29
其中:股票投资		856,563,330.31	880,205,888.29
基金投资		-	-
债券投资		56,727,930.80	50,035,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		85,300,000.00	-
应收证券清算款		16,122,000.00	40,854,240.49
应收利息		1,082,735.52	314,361.99
应收股利		-	-
应收申购款		168,966.92	54,008.07
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,097,645,248.70	1,031,757,943.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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		-	-
应付证券清算款		20,775,318.63	47,703,225.49
应付赎回款		911,774.07	768,434.00
应付管理人报酬		1,282,659.36	1,125,586.35
应付托管费		213,776.55	187,597.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		899,728.14	2,364,543.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,688,678.98	1,791,303.49
负债合计		25,771,935.73	53,940,690.92
所有者权益:			
实收基金		1,064,618,515.52	1,109,187,398.35
未分配利润		7,254,797.45	-131,370,146.12
所有者权益合计		1,071,873,312.97	977,817,252.23
负债和所有者权益总计		1,097,645,248.70	1,031,757,943.15

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值 1.0134 元,基金份额总额为 1,057,669,107.51 份,其中:合润基金份额净值 1.0134 元,份额总额 996,559,931.51 份;合润A基金份额参考净值1.0000元,份额总额 24,443,670.00 份;合润B基金份额参考净值 1.0223 元,份额总额 36,665,506.00 份。

6.2 利润表

会计主体:兴全合润分级股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		158,431,857.37	47,150,558.19
1.利息收入		2,049,919.30	2,014,178.27
其中:存款利息收入		832,124.72	395,034.13
债券利息收入		745,396.36	1,594,546.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		472,398.22	24,597.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		223,101,151.03	-74,762,346.43
其中:股票投资收益		211,014,832.77	-81,397,039.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,102,840.24	833,617.59
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		10,983,478.02	5,801,075.36
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-66,851,320.36	119,731,703.28
4. 汇兑收益 (损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		132,107.40	167,023.07
减:二、费用		15,945,374.24	21,598,104.85
1.管理人报酬		7,962,068.64	9,487,532.19
2.托管费		1,327,011.48	1,581,255.42
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		6,447,152.12	10,314,006.99
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		209,142.00	215,310.25
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		142,486,483.13	25,552,453.34
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		142,486,483.13	25,552,453.34

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全合润分级股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,109,187,398.35	-131,370,146.12	977,817,252.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	142,486,483.13	142,486,483.13
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)	-44,568,882.83	-3,861,539.56	-48,430,422.39
其中:1.基金申购款	257,348,158.00	-4,049,975.45	253,298,182.55
2.基金赎回款	-301,917,040.83	188,435.89	-301,728,604.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,064,618,515.52	7,254,797.45	1,071,873,312.97
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,580,351,787.66	-225,025,378.61	1,355,326,409.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	25,552,453.34	25,552,453.34
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)	-226,286,909.05	31,237,634.04	-195,049,275.01
其中:1.基金申购款	21,490,014.64	-2,871,369.41	18,618,645.23
2.基金赎回款	-247,776,923.69	34,109,003.45	-213,667,920.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,354,064,878.61	-168,235,291.23	1,185,829,587.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

兰荣　　杨东　　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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全合润分级股票型证券投资基金(原名兴业合润分级股票型证券投资基金)(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2010]229号文《关于核准兴业合润分级股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴业全球基金管理有限公司作为管理人于2010年3月22日至2010年4月16日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2010)验字第60467611_B04号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2010年4月22日生效,首次设立募集规模为3,328,967,444.30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为兴业全球基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴全合润分级股票型证券投资基金。

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

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

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

本基金的业绩基准为80%×沪深300指数+20%×中证国债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1.印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(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、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,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,暂不征收企业所得税。

3.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金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,暂减按25%计入应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司(以下简称"兴业全球基金")	基金管理人,基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")	基金托管人,基金销售机构
兴业证券股份有限公司(以下简称"兴业证券")	基金管理人的股东,基金销售机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	14,301,000.00	0.30%	1,310,588,112.61	17.56%

6.4.8.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30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	-	-	21,637,423.80	15.79%

6.4.8.1.3债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30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	13,062.96	0.39%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	1,093,986.41	21.57%	545,797.17	19.26%

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,962,068.64	9,487,532.19
其中:支付销售机构的客户维护费	2,414,007.16	2,483,730.70

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,327,011.48	1,581,255.42

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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2013年1月1日至2013年6月30日		
	兴全合润分级股票	合润A	合润B
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日		
	兴全合润分级股票	合润A	合润B
期初持有的基金份额	13,004,460.00	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	13,004,460.00	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.96%	-	-

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

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

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。

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

兴全合润分级股票				
关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	-	-	29.00	0.00%

合润A				
关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	59.00	0.00%	-	-

合润B				
关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	311,789.00	0.85%	-	-

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

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	77,921,067.18	785,758.98	63,805,829.91	347,076.98

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 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
601789	宁波建工	2013年6月4日	2014年6月3日	非公开发行流通受限	6.51	6.52	1,500,000	9,765,000.00	9,780,000.00	-
600187	国中水务	2013年6月25日	2014年6月23日	非公开发行流通受限	8.10	8.18	1,110,000	8,991,000.00	9,079,800.00	-
002286	保龄宝	2013年4月16日	2014年4月17日	非公开发行流通受限	12.60	12.50	390,000	4,914,000.00	4,875,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限证券。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	856,563,330.31	78.04
	其中:股票	856,563,330.31	78.04
2	固定收益投资	56,727,930.80	5.17
	其中:债券	56,727,930.80	5.17
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	85,300,000.00	7.77
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	79,361,235.05	7.23
6	其他各项资产	19,692,752.54	1.79
7	合计	1,097,645,248.70	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	639,951,565.60	59.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,079,800.00	0.85
E	建筑业	29,574,164.88	2.76
F	批发和零售业	68,828,791.62	6.42
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	48,259,689.99	4.50
K	房地产业	35,263,823.03	3.29
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	25,605,495.19	2.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	856,563,330.31	79.91

7.3 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	600519	贵州茅台	443,337	85,284,738.69	7.96
2	000895	双汇发展	1,497,881	57,578,545.64	5.37
3	300080	新大新材	8,733,987	54,325,399.14	5.07
4	000527	美的电器	3,675,517	45,649,921.14	4.26
5	000963	华东医药	767,856	30,599,061.60	2.85
6	600104	上汽集团	2,253,763	29,772,209.23	2.78
7	002250	联化科技	1,393,469	27,855,445.31	2.60
8	601318	中国平安	800,000	27,808,000.00	2.59
9	600401	海润光伏	4,742,531	27,506,679.80	2.57
10	600600	青岛啤酒	710,487	26,984,296.26	2.52

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.xyfunds.com.cn的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	112,325,106.81	11.49
2	600030	中信证券	96,942,022.34	9.91
3	600519	贵州茅台	78,418,724.20	8.02
4	600048	保利地产	64,831,828.54	6.63
5	300080	新大新材	60,855,920.52	6.22
6	601117	中国化学	59,937,633.93	6.13
7	000024	招商地产	57,461,096.39	5.88
8	000895	双汇发展	56,386,014.48	5.77
9	600000	浦发银行	55,625,742.94	5.69
10	000001	平安银行	53,499,677.95	5.47
11	601989	中国重工	53,302,255.53	5.45
12	000527	美的电器	51,904,929.30	5.31
13	600585	海螺水泥	50,639,004.05	5.18
14	601601	中国太保	39,130,053.32	4.00
15	002583	海能达	36,198,649.58	3.70
16	600104	上汽集团	36,037,767.84	3.69
17	002309	中利科技	35,044,794.45	3.58
18	002422	科伦药业	34,187,905.09	3.50
19	600372	中航电子	33,464,916.90	3.42
20	002013	中航精机	32,511,699.49	3.32
21	000963	华东医药	31,397,227.76	3.21
22	000069	华侨城A	30,548,464.97	3.12
23	600401	海润光伏	28,918,516.03	2.96
24	000049	德赛电池	28,672,673.57	2.93
25	000401	冀东水泥	28,486,528.37	2.91
26	600993	马应龙	28,194,047.53	2.88
27	600976	武汉健民	26,993,981.60	2.76
28	600329	中新药业	26,371,101.82	2.70
29	601328	交通银行	26,326,846.99	2.69
30	000933	神火股份	26,116,766.41	2.67
31	601318	中国平安	26,086,445.09	2.67
32	600600	青岛啤酒	25,790,657.21	2.64
33	000002	万科A	25,140,863.54	2.57
34	600837	海通证券	24,982,131.08	2.55
35	300309	吉艾科技	24,030,075.00	2.46
36	300274	阳光电源	23,839,544.76	2.44
37	600184	光电股份	23,804,243.91	2.43
38	600511	国药股份	23,746,373.48	2.43
39	002152	广电运通	23,383,353.93	2.39
40	000999	华润三九	23,002,294.06	2.35
41	600316	洪都航空	22,763,331.12	2.33
42	600089	特变电工	22,586,639.82	2.31
43	002594	比亚迪	22,503,588.11	2.30
44	000776	广发证券	22,430,714.82	2.29
45	600537	亿晶光电	22,198,657.80	2.27
46	600079	人福医药	21,666,961.60	2.22
47	000848	承德露露	21,480,159.09	2.20
48	600028	中国石化	21,104,207.00	2.16
49	002244	滨江集团	20,690,462.18	2.12

注:"买入金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	121,010,613.38	12.38
2	600030	中信证券	94,126,249.70	9.63
3	002020	京新药业	92,996,369.11	9.51
4	600048	保利地产	80,290,718.35	8.21
5	600867	通化东宝	79,727,228.88	8.15
6	002594	比亚迪	73,912,217.31	7.56
7	600000	浦发银行	73,708,339.13	7.54
8	300088	长信科技	71,648,601.64	7.33
9	601601	中国太保	63,785,461.95	6.52
10	000001	平安银行	60,042,720.53	6.14
11	600208	新湖中宝	59,859,156.20	6.12
12	000024	招商地产	57,526,279.24	5.88
13	601328	交通银行	54,761,786.71	5.60
14	601989	中国重工	54,403,409.19	5.56
15	002250	联化科技	51,524,472.00	5.27
16	601788	光大证券	50,764,323.26	5.19
17	600765	中航重机	50,418,295.07	5.16
18	601117	中国化学	50,221,831.40	5.14
19	600585	海螺水泥	46,135,780.47	4.72
20	600316	洪都航空	45,664,208.20	4.67
21	600376	首开股份	44,218,604.87	4.52
22	600372	中航电子	41,119,800.99	4.21
23	002583	海能达	38,638,353.21	3.95
24	002013	中航精机	35,941,906.30	3.68
25	300136	信维通信	34,267,723.77	3.50
26	600498	烽火通信	33,873,333.43	3.46
27	600705	中航投资	32,089,133.01	3.28
28	600809	山西汾酒	31,773,057.61	3.25
29	300197	铁汉生态	31,204,655.83	3.19
30	000049	德赛电池	29,854,418.62	3.05
31	000063	中兴通讯	29,028,592.52	2.97
32	600993	马应龙	28,499,629.00	2.91
33	601318	中国平安	28,402,077.58	2.90
34	000401	冀东水泥	25,710,383.50	2.63
35	600837	海通证券	25,555,206.88	2.61
36	600329	中新药业	24,156,855.86	2.47
37	600184	光电股份	23,833,456.67	2.44
38	300303	聚飞光电	23,715,389.22	2.43
39	000999	华润三九	23,453,398.11	2.40
40	600893	航空动力	23,164,174.96	2.37
41	000776	广发证券	21,856,030.45	2.24
42	002244	滨江集团	20,838,856.29	2.13
43	300274	阳光电源	20,546,874.67	2.10
44	600028	中国石化	20,321,394.94	2.08
45	002638	勤上光电	20,271,653.75	2.07
46	601998	中信银行	19,731,878.38	2.02

注:"卖出金额"按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,332,139,032.02
卖出股票收入(成交)总额	2,500,494,284.37

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	49,820,000.00	4.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	6,907,930.80	0.64
8	其他	-	-
9	合计	56,727,930.80	5.29

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	120019	12附息国债19	500,000	49,820,000.00	4.65
2	113003	重工转债	63,190	6,907,930.80	0.64

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.9.2本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 贵州茅台酒股份有限公司控股子公司贵州茅台酒销售有限公司于2013年2月22日收到贵州省物价局《行政处罚决定书》(黔价处[2013]1号)。该决定书认为:贵州茅台酒销售有限公司对全国经销商向第三人销售茅台酒的最低价格进行限定,违反了《中华人民共和国反垄断法》第十四条的规定。

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

7.10.2 本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,319,050.10
2	应收证券清算款	16,122,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,082,735.52
5	应收申购款	168,966.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,692,752.54

7.10.4 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	113003	重工转债	6,907,930.80	0.64

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.10.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴全合润分级股票	15,349	64,926.70	215,191,861.32	21.59%	781,368,070.19	78.41%
合润A	2,060	11,865.86	1,756,151.00	7.18%	22,687,519.00	92.82%
合润B	2,400	15,277.29	534,340.00	1.46%	36,131,166.00	98.54%
合计	19,809	53,393.36	217,482,352.32	20.56%	840,186,755.19	79.44%

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

8.2 期末上市基金前十名持有人

合润A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	任春美	1,830,917.00	7.49%
2	中国太保集团股份有限公司-本级-集团自有资金-012G-ZY001	878,737.00	3.59%
3	王哲	605,984.00	2.48%
4	陈云美	541,669.00	2.22%
5	翟燕立	518,333.00	2.12%
6	长江证券-农行-长江证券超越理财经典策略集合资产管理计划	428,814.00	1.75%
7	吕玲	418,798.00	1.71%
8	李宇	400,000.00	1.64%
9	张庆枝	397,425.00	1.63%
10	中国航天科工集团公司企业年金计划-中国银行	377,740.00	1.55%

合润B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	张国荣	1,046,122.00	2.85%
2	王哲	908,977.00	2.48%
3	陈力	713,262.00	1.95%
4	张训苏	639,718.00	1.74%
5	李宇	600,000.00	1.64%
6	张庆枝	596,138.00	1.63%
7	李彤	540,061.00	1.47%
8	赵文利	508,000.00	1.39%
9	莫水凤	484,205.00	1.32%
10	黄广通	417,272.00	1.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全合润分级股票	155,483.20	0.0156%
	合润A	-	-
	合润B	-	-
	合计	155,483.20	0.0147%

注:1、对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总数)。

2、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。

3、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	兴全合润分级股票	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	1,001,518,378.35	43,067,608.00	64,601,412.00
本报告期基金总申购份额	306,991,384.93	1,097,876.00	1,646,814.00
减:本报告期基金总赎回份额	303,810,723.70	20,171,272.00	30,256,908.00
本报告期基金拆分变动份额	-8,139,108.07	449,458.00	674,188.00
本报告期期末基金份额总额	996,559,931.51	24,443,670.00	36,665,506.00

注:1、本期申购含转换转入份额、配对转换转入份额,本期赎回含转换转出份额、配对转换转出份额。其中,合润A、合润B的本期申购(即配对转换入份额)之和等于兴全合润分级股票配对转换出份额;合润A、合润B的本期赎回(即配对转换出份额)之和等于兴全合润分级股票配对转换入份额。

2、兴全合润分级股票型证券投资基金于2013年4月22日进行了定期份额折算、分拆,本基金所有份额净值均调整为1.0000元。定期份额折算、分拆方案详见2013年3月7日登载的《兴业全球基金管理有限公司关于兴全合润分级股票型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务的提示性公告》。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)报告期内基金管理人重大人事变动 (2)报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
信达证券	1	1,061,770,068.30	22.08%	754,281.47	22.27%	新增
中信建投	1	821,388,126.93	17.08%	563,899.58	16.65%	-
银河证券	1	797,271,117.37	16.58%	566,380.17	16.72%	-
国泰君安	2	724,775,852.87	15.07%	509,118.12	15.03%	-
东方证券	1	617,264,318.20	12.84%	438,503.03	12.94%	-
招商证券	2	487,277,506.23	10.13%	340,079.48	10.04%	-
华创证券	1	284,915,326.49	5.92%	202,403.34	5.97%	-
兴业证券	2	14,301,000.00	0.30%	13,062.96	0.39%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
信达证券	16,417,075.00	32.01%	400,200,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	25,227,163.60	49.19%	-	-	-	-
国泰君安	6,149,908.60	11.99%	-	-	-	-
东方证券	3,489,800.80	6.80%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司
2013年8月28日