# 兴全添利宝货币市场基金

## 2016 第二季度 报告

2016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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 兴全添利宝货币 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 000575 |
| 交易代码 | 000575 |
| 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 | 2014年2月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 69,033,166,677.48份 |
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 根据宏观形势、利率走势等因素,确定各个阶段的投资组合平均久期、剩余期限等指标,并在这些指标要求的基础上构建投资组合;进行主动投资,有效提高资产组合收益。本基金综合运用关键配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金 |
| 基金管理人 | 兴业全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 513,377,779.37 |
| 2. 本期利润 | 513,377,779.37 |
| 3. 期末基金资产净值 | 69,033,166,677.48 |

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

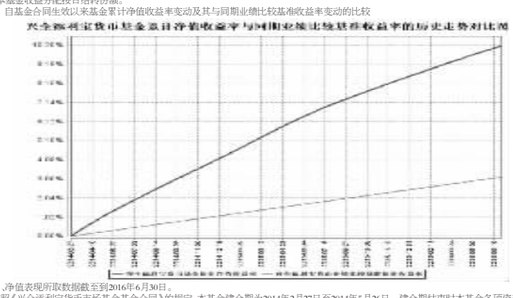
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 0.7113% | 0.0012% | 0.3366% | 0.0000% | 0.3747% | 0.0012% |

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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6月30日。

2.按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2014年2月27日至2014年5月26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本基金投资组合的比例范围。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 钟明 | 固定收益部总监助理兼本基金、兴全货币市场基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理 | 2015年6月30日 | - | 11年 | 工商管理硕士,历任兴业证券基金管理有限公司基金会计、交易员,基金经理助理。 |
| 翟秀华 | 本基金基金经理 | 2016年3月17日 | - | 6年 | 医学硕士,历任毕马威华振会计师事务所审计,泰信基金管理有限公司交易总监助理,兴业全球基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。 |

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(基金成立时拟担任基金经理)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、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

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 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0.7113%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面,美国脱欧事件带来的全球金融市场动荡并未结束,未来可能出现连锁反应,全球避险情绪将逐步抬升;人民币汇率顺势贬值释放了部分压力,预计未来弹性将大幅增加。国内方面,政策着力于"供给侧改革"的思路短期内不会逆转,但是随着民间投资的持续下滑,未来或许将出台一些助力民间投资的政策。物价方面,受钢铁等天气影响,农产品价格或将出现明显上升,从而对CPI产生压力;"供给侧改革"和需求平稳拉动下大宗商品价格提升趋势是否能够持续仍然有待观察。在改革与风险并存格局下,货币政策松紧难某,大概率将保持适度宽松状态。市场方面,随着监管的增强,金融市场格局也将发生变化,其传导路径和具体影响仍有待观察;预计未来债券市场的走势大概率仍以震荡为主,而经济下行和再融资收紧下的企业信用风险仍在积聚,不容小觑。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 25,814,452,343.04 | 34.19 |
| | 其中:债券 | 25,814,452,343.04 | 34.19 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 8,053,851,649.40 | 10.67 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 41,320,185,088.71 | 54.72 |
| 4 | 其他资产 | 324,562,128.98 | 0.43 |
| 5 | 合计 | 75,513,051,210.13 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 5.05 |
| | 其中:买断式回购融资 | | 0.00 |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 5,604,504,357.73 | 8.12 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内未发生债券正回购资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 84 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 84 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 53 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限没有发生超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 35.63 | 9.34 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 13.74 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 20.40 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 28.27 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.08 | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 10.88 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 108.92 | 9.34 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 2,345,970,985.12 | 3.40 |
| | 其中:政策性金融债 | 2,345,970,985.12 | 3.40 |
| 4 | 企业债券 | 13,606,755.21 | 0.02 |
| 5 | 企业短期融资券 | 15,611,270,934.23 | 22.61 |
| 6 | 中期票据 | 1,032,628,161.41 | 1.50 |
| 7 | 同业存单 | 6,810,975,507.07 | 9.87 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 25,814,452,343.04 | 37.39 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 58,551,007.23 | 0.08 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 111694931 | 16重庆农村商行CD073 | 10,000,000 | 992,498,864.60 | 1.44 |
| 2 | 111692987 | 16吉林银行CD059 | 5,000,000 | 498,500,111.17 | 0.72 |
| 3 | 111692999 | 16西安银行CD009 | 5,000,000 | 498,384,436.78 | 0.72 |
| 4 | 111690916 | 16瑞丰银行CD006 | 5,000,000 | 497,397,989.91 | 0.72 |
| 5 | 111691519 | 16广州农村商业银行CD017 | 5,000,000 | 496,571,381.65 | 0.72 |
| 6 | 1182247 | 11中铝股MTN1 | 4,200,000 | 423,154,984.09 | 0.61 |
| 7 | 011699233 | 16宝钢股SCP002 | 3,400,000 | 339,474,159.29 | 0.49 |
| 8 | 070206 | 07国开06 | 3,100,000 | 307,775,916.73 | 0.45 |
| 9 | 140322 | 14进出22 | 3,000,000 | 305,140,320.97 | 0.44 |
| 10 | 011699663 | 16广州发展SCP001 | 3,000,000 | 299,184,015.45 | 0.43 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1016% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0603% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0760% |

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1

本基金估值采用摊余成本法(除特殊情况外),即估值对象以买入成本列示,按照实际利率每日计提应收利息。

5.8.2

本报告期内不存在剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,884.26 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 324,560,244.72 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 324,562,128.98 |

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 72,358,373,048.90 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 68,590,067,538.86 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 71,915,273,910.28 |
| 报告期期末基金份额总额 | 69,033,166,677.48 |

注:总申购份额含红利再投资。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申购 | 2016年4月6日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 2 | 申购 | 2016年4月7日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 3 | 申购 | 2016年4月8日 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 | - |
| 4 | 申购 | 2016年4月11日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 5 | 申购 | 2016年4月12日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 6 | 申购 | 2016年4月13日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 7 | 赎回 | 2016年4月20日 | -69,000,000.00 | -69,000,000.00 | - |
| 8 | 赎回 | 2016年4月20日 | -22,000,000.00 | -22,000,000.00 | - |
| 9 | 赎回 | 2016年4月25日 | -67,000,000.00 | -67,000,000.00 | - |
| 10 | 申购 | 2016年4月28日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 11 | 红利再投 | 2016年4月30日 | 1,851,852.72 | 1,851,852.72 | - |
| 12 | 申购 | 2016年5月3日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 13 | 申购 | 2016年5月4日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 14 | 申购 | 2016年5月6日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 15 | 申购 | 2016年5月9日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 16 | 申购 | 2016年5月10日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 17 | 赎回 | 2016年5月13日 | -54,000,000.00 | -54,000,000.00 | - |
| 18 | 申购 | 2016年5月16日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 19 | 申购 | 2016年5月20日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 20 | 申购 | 2016年5月23日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 21 | 申购 | 2016年5月24日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 22 | 申购 | 2016年5月25日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 23 | 申购 | 2016年5月26日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 24 | 申购 | 2016年5月27日 | 5,000,000.00 | 5,000,000.00 | - |
| 25 | 红利再投 | 2016年5月31日 | 1,750,569.37 | 1,750,569.37 | - |
| 26 | 申购 | 2016年6月1日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 27 | 申购 | 2016年6月2日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 28 | 申购 | 2016年6月3日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 29 | 申购 | 2016年6月6日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 30 | 申购 | 2016年6月7日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 31 | 申购 | 2016年6月13日 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 | - |
| 32 | 申购 | 2016年6月14日 | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 | - |
| 33 | 赎回 | 2016年6月22日 | -3,000,000.00 | -3,000,000.00 | - |
| 34 | 赎回 | 2016年6月29日 | -213,000,000.00 | -213,000,000.00 | - |
| 35 | 红利再投 | 2016年6月30日 | 1,856,561.69 | 1,856,561.69 | - |
| 合计 | | | -162,541,016.22 | -162,541,016.22 | |

注:1."交易日期"为交易确认日或分红权益登记日。

2.因本基金收益分配按日结转份额,上表中"红利再投资"数据为当月汇总数据。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会准予兴全添利宝货币市场基金募集注册的文件
2.关于募集兴全添利宝货币市场基金之法律意见书
3.基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
4.基金托管人业务资格批件和营业执照
5.《兴全添利宝货币市场基金基金合同》
6.《兴全添利宝货币市场基金托管协议》
7.中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站(http://www.xyfunds.com.cn)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。

兴业全球基金管理有限公司

# 兴全全球视野股票型证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 兴全全球视野股票 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 340006 |
| 交易代码 | 340006 |
| 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 | 2006年9月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,891,456,911.08份 |
| 投资目标 | 本基金以全球视野的角度,主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司,追求当期收益实现与长期资本增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略。以全球视野的角度挖掘中国证券市场投资的历史机遇,采取"自上而下"的方法,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。 |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深300指数+15%×中证国债指数+5%×同业存款利率 |
| 风险收益特征 | 较高风险、较高收益 |
| 基金管理人 | 兴业全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2016年4月1日 — 2016年6月30日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 95,485,736.93 |
| 2.本期利润 | 177,103,564.45 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0896 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,151,646,314.32 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.6663 |

注:1.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。

2.所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: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 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | 5.14% | 1.45% | -1.56% | 0.81% | 6.70% | 0.64% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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6月30日。

2.按照《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2006年9月20日至2007年3月19日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴圣涛 | 基金管理部投资副总监兼本基金、兴全商业模式优选混合型基金(LOF)基金经理 | 2015年12月31日 | - | 13年 | 经济学硕士,历任汉唐证券研究员,国泰人寿保险有限责任公司投资经理,华富基金管理有限公司基金经理,东吴基金管理有限公司基金经理,兴业全球基金管理有限公司兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |
| 申庆 | 本基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理 | 2015年12月31日 | - | 18年 | 工商管理硕士,历任兴业全球基金管理有限公司行业研究员,兴全趋势证券投资基金(LOF)基金经理助理、基金管理部总监助理。 |

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(基金成立时拟担任基金经理)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、《兴全全球视野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 公平交易专项说明

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 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5.14%,同期业绩比较基准收益率为-1.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,在宏观数据转优、汇率贬值压力下市场可能难以有大的趋势性机会,但无风险利率的继续下行以及其它资产收益率下滑的对股票是市场会形成一定支撑。我们判断市场在未来较长时间可能会延续震荡走势,我们仍然会坚持以产格的标准去选择个股以控制下行风险,重点通过公司业绩的长期增长来获得投资回报。

从具体投资方向看,兴全全球视野基金将以全球视野的角度,主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司,追求当期收益实现与长期资本增值,力争为投资者创造好的投资收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 2,942,567,361.59 | 92.44 |
| | 其中:股票 | 2,942,567,361.59 | 92.44 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 161,781,452.00 | 5.08 |
| | 其中:债券 | 161,781,452.00 | 5.08 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 53,076,122.16 | 1.67 |
| 8 | 其他资产 | 25,723,625.70 | 0.81 |
| 9 | 合计 | 3,183,148,561.45 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 36,404,752.39 | 1.16 |
| C | 制造业 | 1,795,838,971.54 | 56.98 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 41,072,216.00 | 1.30 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 61,540,105.00 | 1.95 |
| 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 | 201,397,965.90 | 6.39 |
| J | 金融业 | 153,875,467.26 | 4.88 |
| K | 房地产业 | 339,727,576.18 | 10.78 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 312,710,307.32 | 9.92 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,942,567,361.59 | 93.37 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300012 | 华测检测 | 25,259,314 | 312,710,307.32 | 9.92 |
| 2 | 300054 | 鼎龙股份 | 12,257,958 | 306,694,109.16 | 9.73 |
| 3 | 600079 | 人福医药 | 18,010,000 | 302,027,700.00 | 9.58 |
| 4 | 002152 | 广电运通 | 17,564,701 | 288,763,684.44 | 9.16 |
| 5 | 000403 | ST生化 | 5,380,814 | 159,218,286.26 | 5.05 |
| 6 | 300017 | 网宿科技 | 2,257,000 | 151,670,400.00 | 4.81 |
| 7 | 000863 | 三湘股份 | 16,000,000 | 147,200,000.00 | 4.67 |
| 8 | 000919 | 金陵药业 | 9,550,000 | 125,009,500.00 | 3.97 |
| 9 | 300083 | 劲胜精密 | 9,840,000 | 79,900,800.00 | 2.54 |
| 10 | 600716 | 凤凰股份 | 10,335,900 | 76,899,096.00 | 2.44 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 39,976,000.00 | 1.27 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 119,634,000.00 | 3.80 |
| | 其中:政策性金融债 | 119,634,000.00 | 3.80 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 2,171,452.00 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 161,781,452.00 | 5.13 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 120223 | 12国开23 | 900,000 | 89,694,000.00 | 2.85 |
| 2 | 019539 | 16国债11 | 400,000 | 39,976,000.00 | 1.27 |
| 3 | 090221 | 09国开21 | 300,000 | 29,940,000.00 | 0.95 |
| 4 | 132006 | 16皖新EB | 13,500 | 1,350,000.00 | 0.04 |
| 5 | 120001 | 16汉岭EB | 3,300 | 365,772.00 | 0.01 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,753,074.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | 20,759,534.65 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,072,691.84 |
| 5 | 应收申购款 | 2,138,325.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,723,625.70 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300083 | 劲胜精密 | 79,900,800.00 | 2.54 | 非公开发行 |
| 2 | 600716 | 凤凰股份 | 76,899,096.00 | 2.44 | 非公开发行 |

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,048,725,906.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 231,934,445.39 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 389,203,440.71 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,891,456,911.08 |

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 5,871,287.33 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 5,871,287.33 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.31 |

注:买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额,卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金对本基金进行交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准本基金设立的文件
2.《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》
3.《兴全全球视野股票型证券投资基金托管协议》
4.《兴全全球视野股票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.本报告期内在指定信息披露媒体上公开披露的各项公告原件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站(http://www.xyfunds.com.cn)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。

兴业全球基金管理有限公司
2016年7月19日

# 兴全社会责任混合型证券投资基金

## 2016 第二季度 报告

2016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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2016年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 兴全社会责任混合 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 340007 |
| 交易代码 | 340007 |
| 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 | 2008年4月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,530,618,032.47份 |
| 投资目标 | 本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。 |
| 投资策略 | 本基金采用"自上而