

兴全可转债混合型证券投资基金

2013 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	1
§2 基金简介	3
2.1 基金基本情况.....	3
2.2 基金产品说明.....	3
2.3 基金管理人和基金托管人.....	3
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	4
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10

§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	34
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	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	34
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	35
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	35
7.10 投资组合报告附注.....	35
§8 基金份额持有人信息	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	36
§9 开放式基金份额变动	37
§10 重大事件揭示	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	37
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	38
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	38
10.8 其他重大事件.....	39
§11 影响投资者决策的其他重要信息	40
§12 备查文件目录	41
12.1 备查文件目录.....	41
12.2 存放地点.....	41
12.3 查阅方式.....	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全可转债混合型证券投资基金
基金简称	兴全可转债混合
基金主代码	340001
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	兴业全球基金管理有限公司
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	3,028,459,763.77 份
基金合同存续期	不定期

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%×天相可转债指数+15%×中信标普 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		兴业全球基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	蒋松云
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588

传真	021-20398858	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市张杨路 500 号时代广场 19-20 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	兰荣	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业全球基金管理有限公司	上海市浦东新区张杨路 500 号时代广场 19-20 楼

§ 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	123, 448, 772. 92
本期利润	182, 179, 771. 29
加权平均基金份额本期利润	0. 0570
本期加权平均净值利润率	5. 20%
本期基金份额净值增长率	5. 06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-139, 174, 261. 40
期末可供分配基金份额利润	-0. 0460
期末基金资产净值	3, 308, 769, 471. 39
期末基金份额净值	1. 0926
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	312. 34%

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	-4.41%	1.09%	-6.57%	0.92%	2.16%	0.17%
过去三个月	-0.67%	0.84%	-4.33%	0.67%	3.66%	0.17%
过去六个月	5.06%	0.80%	-0.14%	0.72%	5.20%	0.08%
过去一年	3.88%	0.63%	1.14%	0.57%	2.74%	0.06%
过去三年	5.86%	0.61%	-0.78%	0.61%	6.64%	0.00%
自基金合同生效起至今	312.34%	0.75%	95.31%	1.00%	217.03%	-0.25%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：选取天相可转债指数和中信标普 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“天相可转债指数”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。中信标普 300 指数代表效果较好。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

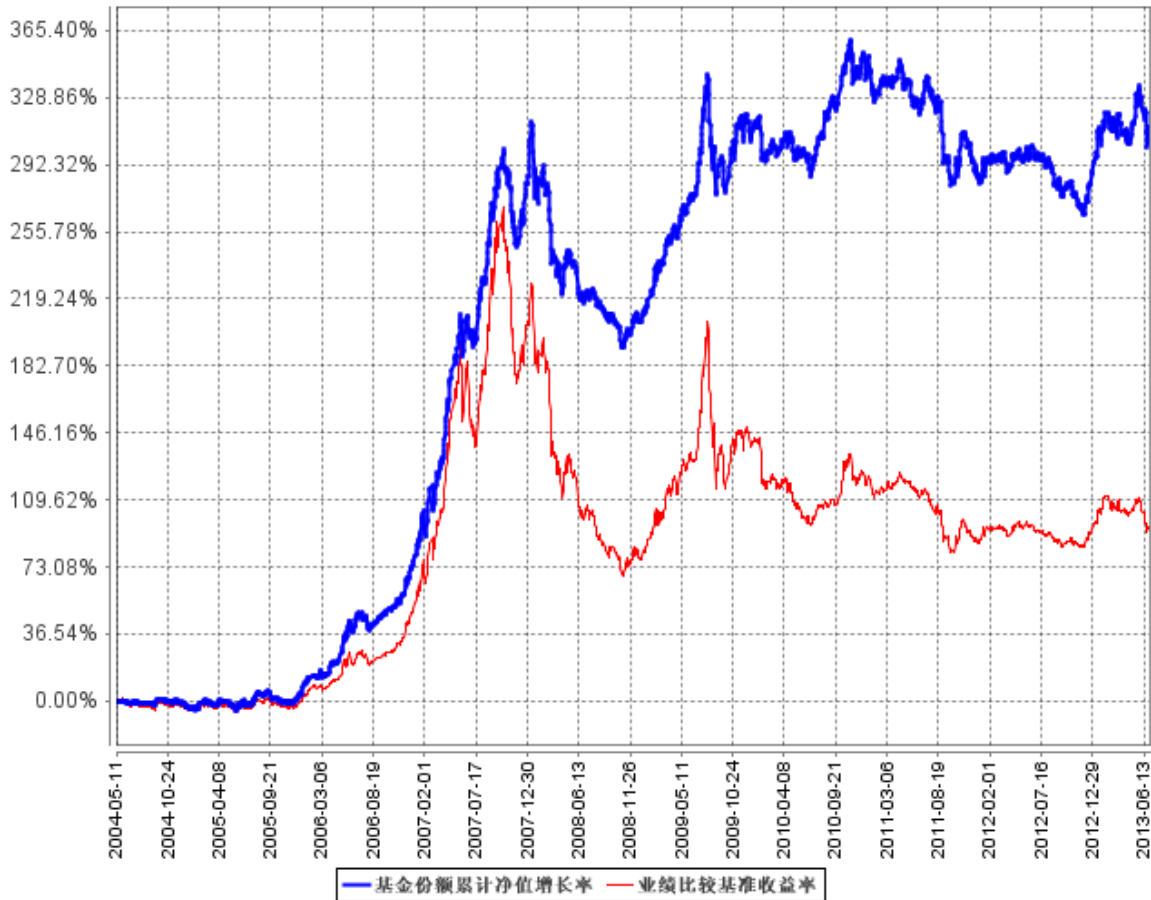
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{天相可转债指数}_t / \text{天相可转债指数}_{t-1} - 1) + 15\% \times (\text{中信标普 300 指数}_t / \text{中信标普 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2013 年 6 月 30 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。

§ 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		
杨云	本基金和兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2007 年 2 月 6 日	-	11 年	1974 年生，理学硕士，历任申银万国证券研究所金融工程部、策略部研究员；兴全可转债混合型证券投资基金的基金经理助理。

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、考察是否存在不公平的因素。

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

上半年股市演绎了极端的结构性分化，以传媒、环保、消费电子、医药为代表的成长性行业气势如虹地贯穿了整个上半年行情。代表蓝筹股和传统行业的沪深 300 指数上半年下跌了 -12.78%，而代表成长股的创业板指数上涨了 41.72%，两者涨幅的差距超过 50%！基金表现的差异也严重拉开。过去过度依赖投资的经济增长模式因为债务的不断攀升越来越陷入困境，而全球基于移动互联网的科技浪潮如火如荼，两者的现实背景是导致股市极端分化的主要原因。

上半年大部分时间资金都较为宽松，固定收益债券表现尚可，但 6 月末货币市场资金面的突然抽紧使得固定收益债券受到冲击，短端收益率大幅攀升。降杠杆的需求以及很多行业公司的现实困境开始影响到投资者对信用的担忧，信用利差开始扩大，市场过去利率风险大于信用风险的状况开始出现改变。可转债作为流动性较好的一类资产，尽管一季度涨幅较大，但在 6 月份资金紧张的情况下大幅杀跌，上半年可转债指数仅上涨 1.9%。

基金年初保持着较高的转债+股票的偏权益仓位，但随着市场的上涨基金对股市调整的预期有些偏早，主要是对经济的预期不乐观，在年初可转债上涨的过程中较早地降低了转债持仓，很多转债后来实际上涨幅更大。错过了一段完全由估值提升推动的转债行情后，基金进一步降低了转债持仓，因此在后来的下跌中相对受损也较小。在 6 月末的下跌后，由于对后续货币政策取向没

把握和预期传统行业仍难有机会的原因，基金也没有趁势提升转债持仓。股票投资上基金上半年做了较大幅度的调整，对原有结构有明显的改变，主要减持了金融和传统行业股票，从行业景气度上较大比例地增持了 led 板块，增持了一些景气度可能延续的电子和环保，同时进一步提升了医药的持仓，在股票的集中度上也有较大提升。主要是对中长期经济面临的结构问题仍不乐观。

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 5.06%，同期业绩比较基准收益率-0.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年基建和房地产投资是经济总量上唯一的亮点，但社融总额与经济增速在数据匹配上让人感到不安，这两块投资拉动社融规模快速扩张，而投入的边际效应却在快速递减。我们一直认为，如何保持债务水平不继续快速扩张的情况下，逐步让政府投资和房地产投资软着陆是关键。但从目前的情况来看，时间和机会可能都在收窄。美元在未来相对全球其他货币的走势可能将是一个重要的变量，比较乐观的结局是人民币在不贬值的情形下仍能保持较好的贸易盈余，中国经济也将自然地完成结构升级和转型。股市的极端分化也是对目前经济局面的囚徒选择。那些静态的低估值也许是因为基本面的风险太大，而新兴产业的估值泡沫只是投资者无法回避系统风险的选择。

因此，个人认为未来结构性去杠杆的过程下经济会进一步趋弱，总需求收缩下股市的系统性风险上升，主要体现在投资相关的传统产业上。而投资者可能会进一步追逐那些新兴的成长产业公司。长期来看，人民币汇率和利率都维持高位的可能性是很低的，这可能导致经济的加速下滑，因此在一系列辅佐政策出台后，货币再次宽松的可能性是较大的。在大类资产配置上基金相对看好长久期的高评级债券和利率债，而可转债也许要等到明显便宜的时候才是阶段的买点。

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 年以上相关工作经验，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《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。本报告期内本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

§ 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——兴业全球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未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴业全球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 2013 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

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	6.4.7.1	58,048,504.04	70,803,230.08
结算备付金		5,965,757.34	2,065,227.04
存出保证金		1,328,630.35	799,056.93
交易性金融资产	6.4.7.2	2,890,187,574.61	3,354,552,526.63
其中：股票投资		897,101,580.88	897,542,483.08
基金投资		-	-
债券投资		1,993,085,993.73	2,457,010,043.55
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,000.00	100,000,000.00
应收证券清算款		107,277,364.09	81,892,385.67
应收利息	6.4.7.5	8,612,033.49	12,675,353.02
应收股利		-	-
应收申购款		48,084,363.98	772,041.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,419,504,227.90	3,623,559,820.46
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		100,000,000.00	-
应付证券清算款		1,649.20	-
应付赎回款		3,295,674.03	2,936,421.69
应付管理人报酬		3,548,274.48	3,842,786.70
应付托管费		682,360.48	738,997.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,394,354.36	1,165,702.38
应交税费		-	-
应付利息		161,911.44	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	650,532.52	952,945.85
负债合计		110,734,756.51	9,636,854.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,028,459,763.77	3,474,879,515.88
未分配利润	6.4.7.10	280,309,707.62	139,043,450.49
所有者权益合计		3,308,769,471.39	3,613,922,966.37
负债和所有者权益总计		3,419,504,227.90	3,623,559,820.46

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0926 元，基金份额总额 3,028,459,763.77 份。

6.2 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：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		217,274,296.71	154,535,872.56
1.利息收入		13,308,233.16	16,904,948.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	989,289.30	912,882.39
债券利息收入		10,895,393.89	15,586,249.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,423,549.97	405,817.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		144,971,477.32	-52,297,698.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	41,264,993.80	-27,236,739.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	97,801,824.95	-30,170,883.46
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,904,658.57	5,109,924.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	58,730,998.37	189,704,472.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	263,587.86	224,149.76
减：二、费用		35,094,525.42	36,527,688.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,582,866.02	26,875,106.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,342,858.89	5,168,289.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	7,424,986.88	4,237,744.77
5. 利息支出		581,277.29	84,427.57

其中：卖出回购金融资产支出		581,277.29	84,427.57
6. 其他费用	6.4.7.19	162,536.34	162,119.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		182,179,771.29	118,008,184.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		182,179,771.29	118,008,184.55

6.3 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：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）	3,474,879,515.88	139,043,450.49	3,613,922,966.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	182,179,771.29	182,179,771.29
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）	-446,419,752.11	-40,913,514.16	-487,333,266.27
其中：1.基金申购款	152,869,168.72	14,334,395.64	167,203,564.36
2.基金赎回款	-599,288,920.83	-55,247,909.80	-654,536,830.63
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）	3,028,459,763.77	280,309,707.62	3,308,769,471.39
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）	3,861,722,014.09	87,387,118.28	3,949,109,132.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,008,184.55	118,008,184.55
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）	19,187,638.61	-4,253,157.17	14,934,481.44
其中：1.基金申购款	380,260,972.68	13,584,149.94	393,845,122.62

2. 基金赎回款	-361, 073, 334. 07	-17, 837, 307. 11	-378, 910, 641. 18
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）	3, 880, 909, 652. 70	201, 142, 145. 66	4, 082, 051, 798. 36

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，由兴业全球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为及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司，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%。

本基金的业绩比较基准为：80%×天相可转债指数+15%×中信标普 300 指数+5%×同业存款利率。

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	58,048,504.04
定期存款	-

其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	58,048,504.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	828,090,930.87	897,101,580.88	69,010,650.01
债券	交易所市场	1,809,930,311.40	1,753,372,993.73
	银行间市场	239,680,556.71	239,713,000.00
	合计	2,049,610,868.11	1,993,085,993.73
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,877,701,798.98	2,890,187,574.61	12,485,775.63

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	19,616.59

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,416.05
应收债券利息	8,385,064.39
应收买入返售证券利息	204,398.35
应收申购款利息	-
其他	538.11
合计	8,612,033.49

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,392,577.00
银行间市场应付交易费用	1,777.36
合计	2,394,354.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	1,765.00
预提费用	148,767.52
合计	650,532.52

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,474,879,515.88	3,474,879,515.88
本期申购	152,869,168.72	152,869,168.72
本期赎回(以“-”号填列)	-599,288,920.83	-599,288,920.83
本期末	3,028,459,763.77	3,028,459,763.77

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-296,201,472.07	435,244,922.56	139,043,450.49
本期利润	123,448,772.92	58,730,998.37	182,179,771.29
本期基金份额交易产生的变动数	33,578,437.75	-74,491,951.91	-40,913,514.16
其中：基金申购款	-8,879,533.45	23,213,929.09	14,334,395.64
基金赎回款	42,457,971.20	-97,705,881.00	-55,247,909.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-139,174,261.40	419,483,969.02	280,309,707.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	921,656.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	59,537.55
其他	8,095.29
合计	989,289.30

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	2,357,260,317.05
减：卖出股票成本总额	2,315,995,323.25
买卖股票差价收入	41,264,993.80

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,258,041,667.63
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,150,608,947.19
减：应收利息总额	9,630,895.49
债券投资收益	97,801,824.95

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,904,658.57
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,904,658.57

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	58,730,998.37
——股票投资	71,855,698.02
——债券投资	-13,124,699.65
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	58,730,998.37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	243,190.85
转换费收入	20,397.01
合计	263,587.86

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	7,423,836.88
银行间市场交易费用	1,150.00
合计	7,424,986.88

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	99,178.95
帐户维护费	9,400.00
银行汇划费	4,368.82
合计	162,536.34

6.4.7.20 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、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	基金托管人、基金销售机构

行”)	
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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	707,600,182.97	15.40%	1,156,159,147.31	42.21%

6.4.10.1.2 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	604,645,627.74	16.10%	156,115,028.40	19.54%

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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	50,000,000.00	1.61%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	699,270.29	15.44%	365,849.35	15.29%
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	983,955.08	41.53%	463,500.68	44.96%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	22,582,866.02	26,875,106.83
其中：支付销售机构的客户维护费	3,268,399.08	3,444,096.95

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。

6.4.10.2.2 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	4,342,858.89	5,168,289.76

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	12,488,422.29	112,488,422.29
期间申购/买入总份额	43,604,679.21	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	12,488,422.29	-
期末持有的基金份额	43,604,679.21	112,488,422.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.44%	2.90%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		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
工商银行	58,048,504.04	921,656.46	75,274,605.03	844,821.05

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002298	鑫龙电器	2012 年 7 月 18 日	2013 年 7 月 19 日	非公开发行流通受限	6.72	7.53	2,769,700	18,612,384.00	20,855,841.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300027	华谊兄弟	2013 年 6 月 5 日	重大事项公告	28.55	2013 年 7 月 24 日	31.41	100,000	3,189,752.40	2,855,000.00	-
002252	上海莱士	2013 年 3 月 26 日	重大事项公告	21.00	2013 年 7 月 2 日	22.80	120,970	2,027,049.50	2,540,370.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 100,000,000.00 元，于 2013 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	58,048,504.04	-	-	-	-	-	58,048,504.04
结算备付金	5,965,757.34	-	-	-	-	-	5,965,757.34
存出保证金	1,328,630.35	-	-	-	-	-	1,328,630.35
交易性金融资产	50,030,000.00	119,796,000.00	69,887,000.00	1,749,782,588.01	3,590,405.72	897,101,580.88	2,890,187,574.61
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	107,277,364.09	107,277,364.09
应收利息	-	-	-	-	-	8,612,033.49	8,612,033.49
应收申购款	4,671.97	-	-	-	-	48,079,692.01	48,084,363.98
资产总计	415,377,563.70	119,796,000.00	69,887,000.00	1,749,782,588.01	3,590,405.72	1,061,070,670.47	3,419,504,227.90
负债							
卖出回购金融资产款	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,649.20	1,649.20
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,295,674.03	3,295,674.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,548,274.48	3,548,274.48
应付托管费	-	-	-	-	-	682,360.48	682,360.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,394,354.36	2,394,354.36
应付利息	-	-	-	-	-	161,911.44	161,911.44
其他负债	-	-	-	-	-	650,532.52	650,532.52
负债总计	100,000,000.00	-	-	-	-	10,734,756.51	110,734,756.51
利率敏感度缺口	315,377,563.70	119,796,000.00	69,887,000.00	1,749,782,588.01	3,590,405.72	1,050,335,913.96	3,308,769,471.39
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	70,803,230.08	-	-	-	-	-	70,803,230.08
结算备付金	2,065,227.04	-	-	-	-	-	2,065,227.04
存出保证金	-	-	-	-	-	799,056.93	799,056.93
交易性金融资产	-	-127,160,178.40	1,974,573,745.95	355,276,119.20	897,542,483.08	-	3,354,552,526.63
买入返售金融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	81,892,385.67	81,892,385.67
应收利息	-	-	-	-	-	12,675,353.02	12,675,353.02
应收申购款	7,800.24	-	-	-	-	764,240.85	772,041.09
资产总计	172,876,257.36	-127,160,178.40	1,974,573,745.95	355,276,119.20	993,673,519.55	-	3,623,559,820.46
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,936,421.69	2,936,421.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,842,786.70	3,842,786.70
应付托管费	-	-	-	-	-	738,997.47	738,997.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,165,702.38	1,165,702.38
其他负债	-	-	-	-	-	952,945.85	952,945.85
负债总计	-	-	-	-	-	9,636,854.09	9,636,854.09
利率敏感度缺口	172,876,257.36	-127,160,178.40	1,974,573,745.95	355,276,119.20	984,036,665.46	-	3,613,922,966.37

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013年6月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	利率 +1%	-1,689,785.73	-4,223,806.45
	利率 -1%	1,745,346.54	4,401,763.27

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	897,101,580.88	27.11	897,542,483.08	24.84
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	1,993,085,993.73	60.24	2,457,010,043.55	67.99
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,890,187,574.61	87.35	3,354,552,526.63	92.82

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动	
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析	
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)

		本期末（2013年6月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	业绩比较基准 -10%	-265,881,725.88	-442,432,334.14
	业绩比较基准 +10%	265,881,725.88	442,432,334.14

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

6.4.14 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	897,101,580.88	26.23
	其中：股票	897,101,580.88	26.23
2	固定收益投资	1,993,085,993.73	58.29
	其中：债券	1,993,085,993.73	58.29
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	300,000,000.00	8.77
	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	64,014,261.38	1.87
6	其他各项资产	165,302,391.91	4.83
7	合计	3,419,504,227.90	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	20,729,792.70	0.63
B	采矿业	-	-

C	制造业	722,586,527.56	21.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	33,203,563.60	1.00
F	批发和零售业	47,842,120.85	1.45
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	55,875,441.39	1.69
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	4,289,134.78	0.13
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	2,855,000.00	0.09
S	综合	9,720,000.00	0.29
	合计	897,101,580.88	27.11

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600867	通化东宝	10,343,227	154,010,650.03	4.65
2	600703	三安光电	6,000,000	117,840,000.00	3.56
3	002638	勤上光电	7,187,162	99,254,707.22	3.00
4	300303	聚飞光电	3,513,085	56,033,705.75	1.69
5	300017	网宿科技	1,113,023	43,374,506.31	1.31
6	002236	大华股份	963,156	36,821,453.88	1.11
7	000963	华东医药	897,871	35,780,159.35	1.08
8	300055	万邦达	849,196	33,203,563.60	1.00
9	300228	富瑞特装	400,000	32,000,000.00	0.97
10	300346	南大光电	633,046	26,562,610.16	0.80
11	600079	人福医药	1,000,000	26,080,000.00	0.79
12	002008	大族激光	2,084,619	23,326,886.61	0.71

13	002298	鑫龙电器	2,769,700	20,855,841.00	0.63
14	000998	隆平高科	999,990	20,729,792.70	0.63
15	300136	信维通信	793,862	19,290,846.60	0.58
16	002250	联化科技	867,141	17,334,148.59	0.52
17	600389	江山股份	500,000	17,020,000.00	0.51
18	300034	钢研高纳	1,014,418	15,794,488.26	0.48
19	300349	金卡股份	278,649	11,371,665.69	0.34
20	002262	恩华药业	506,774	11,275,721.50	0.34
21	600256	广汇能源	750,000	9,720,000.00	0.29
22	600597	光明乳业	686,222	9,257,134.78	0.28
23	002241	歌尔声学	205,895	7,471,929.55	0.23
24	300315	掌趣科技	200,000	6,596,000.00	0.20
25	300124	汇川技术	187,233	6,551,282.67	0.20
26	600315	上海家化	141,198	6,352,498.02	0.19
27	600351	亚宝药业	999,996	6,139,975.44	0.19
28	002594	比亚迪	200,000	5,982,000.00	0.18
29	600718	东软集团	725,422	5,904,935.08	0.18
30	600114	东睦股份	499,929	4,694,333.31	0.14
31	000826	桑德环境	132,914	4,289,134.78	0.13
32	300027	华谊兄弟	100,000	2,855,000.00	0.09
33	002252	上海莱士	120,970	2,540,370.00	0.08
34	600976	武汉健民	36,400	786,240.00	0.02

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	600703	三安光电	174,006,107.57	4.81
2	600867	通化东宝	123,024,928.67	3.40
3	600028	中国石化	106,050,849.34	2.93
4	002638	勤上光电	104,715,056.48	2.90
5	002250	联化科技	71,711,218.59	1.98
6	600016	民生银行	60,962,394.43	1.69
7	300303	聚飞光电	57,423,699.28	1.59
8	300115	长盈精密	57,235,039.01	1.58

9	600031	三一重工	51,734,385.69	1.43
10	600406	国电南瑞	51,349,952.56	1.42
11	600104	上汽集团	50,139,544.20	1.39
12	002008	大族激光	43,137,197.44	1.19
13	300017	网宿科技	42,854,489.58	1.19
14	600157	永泰能源	41,941,400.55	1.16
15	600702	沱牌舍得	40,800,081.53	1.13
16	002236	大华股份	38,104,837.83	1.05
17	000963	华东医药	37,590,745.11	1.04
18	002005	德豪润达	37,195,793.47	1.03
19	600519	贵州茅台	36,667,785.85	1.01
20	002482	广田股份	36,263,753.97	1.00

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	600143	金发科技	180,886,116.92	5.01
2	601318	中国平安	176,365,171.33	4.88
3	600028	中国石化	101,670,671.81	2.81
4	601166	兴业银行	99,972,388.45	2.77
5	600703	三安光电	87,402,526.94	2.42
6	002477	雏鹰农牧	79,441,277.00	2.20
7	002594	比亚迪	69,602,257.07	1.93
8	600529	山东药玻	68,874,929.61	1.91
9	300115	长盈精密	67,072,047.17	1.86
10	600016	民生银行	62,490,438.16	1.73
11	300228	富瑞特装	58,696,725.13	1.62
12	600406	国电南瑞	52,715,743.60	1.46
13	600031	三一重工	49,066,718.51	1.36
14	600104	上汽集团	44,532,179.74	1.23
15	002005	德豪润达	44,025,098.33	1.22
16	601601	中国太保	43,279,224.68	1.20
17	002250	联化科技	42,470,222.54	1.18
18	600702	沱牌舍得	41,772,249.01	1.16
19	002582	好想你	41,713,073.96	1.15

20	601100	恒立油缸	37,203,860.63	1.03
----	--------	------	---------------	------

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	2,243,698,723.03
卖出股票收入（成交）总额	2,357,260,317.05

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	39,812,000.00	1.20
2	央行票据	99,680,000.00	3.01
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	31,069,700.00	0.94
5	企业短期融资券	100,221,000.00	3.03
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,722,303,293.73	52.05
8	其他	-	-
9	合计	1,993,085,993.73	60.24

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	113001	中行转债	7,864,170	787,282,058.70	23.79
2	113003	重工转债	2,616,790	286,067,482.80	8.65
3	110018	国电转债	1,766,640	189,878,467.20	5.74
4	110016	川投转债	1,128,370	136,307,096.00	4.12
5	1001079	10 央行票据 79	1,000,000	99,680,000.00	3.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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。

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	1,328,630.35
2	应收证券清算款	107,277,364.09
3	应收股利	-
4	应收利息	8,612,033.49
5	应收申购款	48,084,363.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	165,302,391.91

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	113001	中行转债	787,282,058.70	23.79
2	113003	重工转债	286,067,482.80	8.65
3	110018	国电转债	189,878,467.20	5.74

4	110016	川投转债	136,307,096.00	4.12
5	110007	博汇转债	84,919,770.00	2.57
6	110011	歌华转债	74,877,280.00	2.26
7	110012	海运转债	70,566,190.00	2.13
8	110015	石化转债	49,910,000.00	1.51
9	110017	中海转债	34,399,141.00	1.04
10	127001	海直转债	3,590,405.72	0.11
11	125887	中鼎转债	2,618,399.51	0.08
12	110019	恒丰转债	1,887,002.80	0.06

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

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
64,931	46,641.20	637,559,456.89	21.05%	2,390,900,306.88	78.95%

8.2 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	3,836,329.16	0.1267%

注：1、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 100 万份以上。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

§ 9 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	3,474,879,515.88
本报告期基金总申购份额	152,869,168.72
减：本报告期基金总赎回份额	599,288,920.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,028,459,763.77

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。

§ 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无重大人事变动。
- （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	
国泰君安	2	932,053,984.98	20.29%	953,012.38	21.04%	-
中银国际	2	818,682,611.35	17.82%	739,008.68	16.32%	-
兴业证券	3	707,600,182.97	15.40%	699,270.29	15.44%	-
光大证券	1	700,508,704.99	15.25%	634,957.69	14.02%	-
申银万国	2	556,943,419.08	12.12%	609,670.52	13.46%	-
中信建投	2	453,793,707.69	9.88%	482,958.58	10.66%	-
中金公司	1	425,006,429.02	9.25%	410,434.35	9.06%	-
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。

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
国泰君安	1,055,277,349.00	28.09%	250,000,000.00	8.04%	-	-
中银国际	43,027,357.71	1.15%	-	-	-	-
兴业证券	604,645,627.74	16.10%	50,000,000.00	1.61%	-	-
光大证券	56,574,381.09	1.51%	-	-	-	-
申银万国	1,053,244,873.14	28.04%	600,000,000.00	19.29%	-	-
中信建投	706,116,650.29	18.80%	1,810,000,000.00	58.20%	-	-
中金公司	237,536,480.58	6.32%	400,000,000.00	12.86%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2012 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 1 月 1 日
2	关于长期停牌股票（万科 A）估值政策调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 1 月 12 日
3	关于设立上海兴全睿众资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 1 月 17 日
4	关于在平安银行开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 1 月 21 日
5	关于调整旗下基金在瑞银证券有限责任公司定期定额投资起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 1 月 29 日
6	关于赎回兴全可转债基金份额以及兴全轻资产基金份额的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 2 月 19 日
7	关于旗下部分基金继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 3 月 30 日
8	关于旗下部分基金参加好买基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 4 月 24 日
9	关于旗下基金持有的“上海家化”股票估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 5 月 16 日
10	关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 5 月 17 日
11	关于旗下部分基金参加信达证券基金申购或定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 5 月 17 日
12	关于旗下部分基金继续参加重庆银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 5 月 22 日
13	关于长期停牌股票（长信科技）估值政策调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 5 月 22 日
14	关于暂停接受银联通顺德农商行网上直销业务申请的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 7 日

15	关于长期停牌股票（新华医疗）估值政策调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 8 日
16	关于长期停牌股票（华策影视）估值政策调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 14 日
17	关于增加江南农村商业银行旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 20 日
18	关于公司固有资金赎回兴全有机增长基金、将兴全全球视野基金部分转换为兴全可转债基金的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 22 日
19	关于长期停牌股票（美的电器）估值政策调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 25 日
20	关于在直销渠道开通旗下基金跨 TA 转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 26 日
21	关于调整网上直销平台基金转换业务费率的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 26 日
22	关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金营养组合申购费率“折上折”优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 29 日
23	关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 29 日
24	旗下各基金 2013 年 6 月 28 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2013 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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。

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

兴业全球基金管理有限公司

2013 年 8 月 28 日