

### Disclosure

注：投资者欲了解本报告期内本基金投资的所有股票明细，应阅读刊载于本公司网站<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 买入卖出金额超过期初基金资产净值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	601014	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	亿纬锂能	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/卖出金额超过基金资产净值比例以成交金额 剔除，不考虑相关交易费用。

7.4.2 卖出买入金额超过期初基金资产净值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	68,602,257.07	1.93
8	600529	山东药玻	69,874,929.61	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	中国神华	43,279,028.63	1.18
17	002250	联化科技	42,470,222.54	1.20
18	600702	亿纬锂能	41,772,249.01	1.16
19	000582	广信材料	41,712,032.06	1.16

20	601101	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序的前五名债券投资明细					
金额单位：人民币元					
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	央行转债	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前十名资产支持证券投资明细					
本基金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					
股指期货投资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,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未持有投资于超出基金合同规定选股库之外的股票。					
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				
6	其他应收款		48,084,363.98		
7	待摊费用				
8	其他				

9	合计			165,302,391.91
7.10.4	期末持有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	113301	中行转债	787,282,058.70	23.79
2	113303	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	91,391,770.00	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	报告期内买入或卖出公允价值占成本比例高于5%的股票、债券和资产支持证券的情况			
由于申购赎回及内部认购,本基金与组合中资产之间可能存在买卖。				

§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 期末基金管理人从业人员的持有本基金的情况					
项目		持有份额总数(份)		项目	

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)持有本基金份额总数的数量区间为100万份以上。					
---	--	--	--	--	--

2、本基金的基金经理持有本基金基金份额总数的数量区间为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,转换入份额,总赎回份额含转换转出份额。

</

美元证券	694,645,627.74	16.10%	50,000,000.00	1.61%
欧元证券	56,574,381.09	1.51%		
英国国债	1,053,244,873.14	28.04%	600,000,000.00	19.29%
中国国债	706,116,658.29	18.80%	1,810,000,000.00	58.20%
香港公司债	237,536,480.58	6.32%	400,000,000.00	12.86%
欧元证券				
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b>				
无。				
<p style="text-align: right;"> <b>兴业全球基金管理有限公司</b>  <b>2013年8月28日</b> </p>				