兴全可转债混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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:2016年3月25日

§1 重要提示

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2016年3月24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。

本报告期自2015年01月01日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全可转债混合
场内简称	-
基金主代码	340001
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	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	1,984,975,281.06份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

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%×中证可转换债券指数+15%×沪深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。

注:自2015年1月26日起,本基金业绩比较基准由“80%×大相可转债指数+15%×中信标普300 指数+5%×同业存款利率”变更为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率”

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	洪渊
	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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	875,489,715.16	967,713,687.47	294,534,082.22
本期利润	449,878,270.04	1,467,957,781.24	339,881,300.16
加权平均基金份额本期利润	0.1935	0.6110	0.1125
本期基金份额净值增长率	6.70%	53.29%	9.84%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0406	0.2781	-0.0056
期末基金资产净值	2,232,629,715.96	4,510,935,004.56	2,783,761,024.78
期末基金份额净值	1.1248	1.6092	1.1254

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1》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。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去三个月	9.29%	0.58%	6.72%	1.14%	2.57%	-0.56%
过去六个月	-2.33%	1.47%	-15.19%	2.90%	12.86%	-1.43%
过去一年	6.70%	1.63%	-20.00%	2.82%	26.70%	-1.19%
过去三年	79.65%	1.21%	20.20%	1.77%	59.45%	-0.56%
过去五年	57.72%	0.99%	6.80%	1.41%	50.92%	-0.42%
自基金合同生效起至今	605.11%	0.88%	135.09%	1.25%	470.02%	-0.37%

注:1.本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:选取中证可转换债券指数和沪深300指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“中证可转换债券指数”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。沪深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:

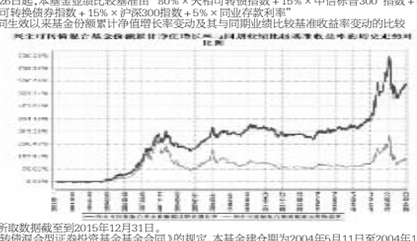
Return t =80%×(中证可转换债券指数t /中证可转换债券指数t-1-1) +15%× (沪深300指数t / 沪深300指数t-1-1)+5%×(同业存款利率t/360)

Benchmark t =(1+Return t)×(1+Benchmark t-1)-1

其中,t=1,2,3,… T,T表示时间截至日。

2.自2015年1月26日起,本基金业绩比较基准由“80%×天相可转债指数+15%×中信标普300 指数+5%×同业存款利率”变更为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率”

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

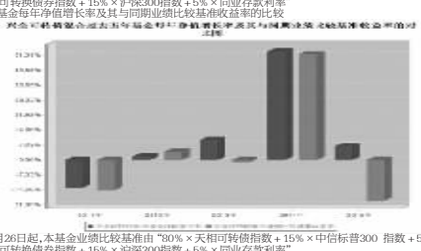


注:1.净值表现所取数据截至到2015年12月31日。

2.按照《兴全可转债混合型证券投资基金合同》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。

3.自2015年1月26日起,本基金业绩比较基准由“80%×天相可转债指数+15%×中信标普300 指数+5%×同业存款利率”变更为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率”

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:自2015年1月26日起,本基金业绩比较基准由“80%×天相可转债指数+15%×中信标普300 指数+5%×同业存款利率”变更为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率”

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	6.220	2,487,792,767.58	895,000,841.25	3,382,793,608.83	
2014	0.840	71,988,559.39	129,968,716.38	201,957,275.77	
2013	0.170	20,746,783.98	26,942,730.19	47,689,514.17	
合计	7.230	2,580,528,110.96	1,051,912,287.82	3,632,440,398.77	

§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是经中国证监会(证监基字[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%。同期公司名称由“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”。2006年7月7日,经中国证监会批准(证监许可[2006]188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。

截止2015年12月31日,公司旗下管理着十七只基金,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、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全稳稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金。

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		
张亚辉	本基金基金经理	2015年7月13日	-	10年	经济学学士。历任兴业全球基金管理有限公司渠道经理、财务会计、固定收益交易员、专户投资部投资经理。
陈宇	本基金基金经理	2015年8月25日	-	9年	理学硕士。历任兴业证券研究员、兴业全球基金管理有限公司研究员、兴业全球基金管理有限公司专户投资部投资经理。
杨云	-	2007年2月6日	2015年8月25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(基金成立时间早于基金经理)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。管理人于2015年8月31日收到上海证监局发出的《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,要求对人员行为和异常交易加强日常管理。管理人已积极整改。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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴全球基金管理有限公司公平交易制度》,并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范,从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

2015年基金融市场跌宕起伏的一年。上半年在货币极度宽松、各种金融创新工具提高杠杆率、大量新投资者入市和强烈的改革预期等多种利好的共同作用下,A股走出波澜壮阔的普涨行情;6-7月对杠杆的清查导致第一轮股灾,8月人民币汇率快速贬值3%,引发第二轮股灾,第四季度在多项数在推稳政策的作用下,股指缓慢修复。全年上证综指涨幅为9.41%,创业板弹性大于主板,全年收涨106.61%。

债券市场由于货币的放松,全年走牛,特别是下半年股灾后,收益率迅速下降。可转债比较特殊,跟随股市经历了大幅上涨再大幅下跌的过程,全年中证转债指数收跌26.54%。上半年大涨导致中行、石化等大盘转债陆续触发强制赎回并最终退市,全年共有29只转债退市,仅有5只转债及4只分券可交换债发行。市场存量规模大幅下降,市场规模由年初的1190亿缩减至年末250亿,剩余转债受稀缺性影响估值高企,可转债的可操作性大大下降。

在股票、可转债和债券行情分化、各项资产振幅巨大的2015年,资产配置和仓位的调整显得尤其重要。本基金上半年提高了股票和转债的仓位,享受了权益类资产的上涨,股灾期间降低了仓位,4季度又适当加大了权益类资产配置,基本没有错过估值修复的过程,但转债受稀缺性影响,全年溢价较高,向上弹性弱于股票。在合同限定的资产比例的框架下,本基金基本完成了绝对收益的目标。

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为6.70%,同期业绩比较基准收益率为-20.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观层面看,大多数传统产业仍然面临产能过剩、负债高企的困局,并继续受到互联网的冲击,一带一路、债务置换等托底政策只能是时间换空间,传统行业大概率是继续过苦日子,2016年供给侧改革可能加大信用风险的暴露。“万众创新”的新兴行业是未来的希望所在,但由于标的稀缺,估值一直较贵。在经济转型的大背景下,资本市场承载了打通投融资通道、为实体经济输血的历史使命,2016年注册制的逐步推进必将加大股票的供给,高估值股票需要加行细的甄别。

但好的方面是经过两次股灾、A股的系统风险已经大大释放,海外来看,方面美联储首次加息后,全球金融市场动荡不安,后续加息步伐可能受到牵制。日欧的疲软和新兴市场的赢弱反而凸显了中国的投资机会,毕竟从全球配置的角度,中国是有相对收益的,人民币大幅贬值的风险大大降低。若国内外措施得当,中国经济和金融市场都有修整、重生的机会,结构性行情仍值得期待。

债券市场方面,虽然面临政府债供给增加和信用风险增大的可能,但全球货币宽松、呼护复苏的基调短期内难以改变,只要国内外流动性没有收紧,利率大幅上行的概率就很低。在人民币国际化,资本项目逐渐开放的政策背景下,海外对中国固定收益类资产有强烈的配置需求,毕竟比起欧美,中国债券仍有较高的收益率。

转债方面,在纯无强行等大盘转债预案的情况下在2016年整体市场规模达到1000亿仍有一定难度,供给仍然不足。但经过两次股灾,部分转债已经跌出了一定程度的债底保护,从绝对收益的角度,有一定的配置价值。

综合股票、固定收益和债券三个资产的情况,相比2014到2015年上半年的单边上涨行情,2016年是考验投资者的一年,本基金将秉承“严控下行风险”的优良传统,灵活配置资产,挑选价值类型的个券,尽量追求“安全的收益”。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展,有力地保证了本基金整体运作的合法合规,从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益:

1.实时风险监控:通过风控系统对本基金的运作进行实时监控,每日撰写监控日志,在此基础上每周撰写信息周报,对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2.加强事后人工分析,并定期撰写风险管理报告。除系统控制外,公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核,并同样反映在监控日志和信息周报中。为此,在每个季度结束之后,公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告,对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告,并提交公司领导和基金经理审阅。

3.进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展,公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准,将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平,主要包括:(1)明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责,保证交易的公平;(2)通过1)检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法,对以往的下单及交易记录进行分析,保证投资策略的公平。

4.季度监察稽核和专项稽核:根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理公司监察稽核报告内容与格式指引(试行)》等规定,认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表,对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外,在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中,也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 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式保证估值准确无误。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。

4.8 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。本报告期内本基金已实施利润分配3次,共分配利润3,382,793,608.83元,符合本基金基金合同的相关规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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对基金份额持有人进行了3次利润分配,分配金额为3,382,793,608.83元。

5.3 托管人对本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2015年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 审计报告

姓名	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(16)第P0565号
备注	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:兴全可转债混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款		478,336,418.78	150,137,946.74
结算备付金		4,645,313.33	29,183,062.21
存出保证金		997,122.36	560,862.62
交易性金融资产		1,812,335,075.00	4,073,971,505.65
其中:股票投资		471,529,976.06	1,010,381,005.65
基金投资		-	-
债券投资		1,340,805,098.94	3,063,590,500.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	329,970,934.96
应收证券清算款		38,491,319.67	-
应收利息		9,883,599.48	14,782,873.61
应收股利		-	-
应收申购款		881,315.34	11,145,972.95
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,345,570,163.96	4,609,753,158.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		105,000,000.00	50,000,000.00
应付证券清算款		-	17,650,512.49
应付赎回款		3,339,832.74	21,500,748.77
应付管理人报酬		2,513,127.55	4,440,455.84
应付托管费		483,293.77	853,933.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,230,406.14	4,135,163.25
应交税费		-	-
应付利息		-	6,921.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		373,787.80	230,418.34
负债合计		112,940,448.00	98,818,154.18
所有者权益:			
实收基金		1,984,975,281.06	2,803,247,209.18
未分配利润		247,654,434.90	1,707,687,795.38
所有者权益合计		2,232,629,715.96	4,510,935,004.56
负债和所有者权益总计		2,345,570,163.96	4,609,753,158.74

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.1248元,基金份额总额1,984,975,281.06份。

7.2 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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一.收入		523,279,069.74	1,556,897,328.64
1.利息收入		28,300,245.89	33,650,657.93
其中:存款利息收入		6,811,454.30	1,429,515.01
债券利息收入		18,957,635.39	30,893,494.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,531,156.20	1,327,648.84
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		907,391,079.12	1,021,737,911.10
其中:股票投资收益		583,177,279.36	250,040,963.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益		321,963,469.35	768,351,512.19
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		2,250,330.41	3,345,435.82
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-425,611,445.12	500,244,093.77
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		13,199,189.85	1,264,665.84
减:二.费用		73,400,799.70	88,939,547.40
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	40,275,485.86	37,613,457.94
2. 托管费	7.4.8.2.2	7,745,285.77	7,233,357.23
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		22,418,374.83	12,861,441.41
5. 利息支出		2,579,849.39	30,884,614.93
其中:卖出回购金融资产支出		2,579,849.39	30,884,614.93
6. 其他费用		381,803.85	346,675.89
三.利润总额(亏损总额以“-”号填列)		449,878,270.04	1,467,957,781.24
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以“-”号填列)		449,878,270.04	1,467,957,781.24

7.3 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:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31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)	2,803,247,209.18	1,707,687,795.38	4,510,935,004.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	449,878,270.04	449,878,270.04
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)	-818,271,928.12	1,472,881,978.31	654,610,050.19
其中:1.基金申购款	7,431,149,205.73	4,913,993,438.56	12,345,142,644.29
2.基金赎回款	-8,249,421,133.85	-3,441,111,460.25	-11,690,532,594.10
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)	-	-3,382,793,608.83	-3,382,793,608.83
五、期末所有者权益(基金净值)	1,984,975,281.06	247,654,434.90	2,232,629,715.96

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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)	2,473,615,007.01	310,146,017.77	2,783,761,024.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,467,957,781.24	1,467,957,781.24
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)	329,632,202.17	131,541,272.14	461,173,474.31
其中:1.基金申购款	1,714,940,404.58	487,538,571.28	2,202,478,975.86
2.基金赎回款	-1,385,308,202.41	-355,997,299.14	-1,741,305,501.55
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)	-	-201,957,275.77	-201,957,275.77
五、期末所有者权益(基金净值)	2,803,247,209.18	1,707,687,795.38	4,510,935,004.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

杨东 詹鸿飞

兰荣

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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60%),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%。

本基金业绩比较基准为:自2015年1月26日起,本基金业绩比较基准由“80%×天相可转债指数+15%×中信标普300 指数+5%×同业存款利率”变更为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率”。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

-

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会发布的《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24 号)的要求,本基金本报告期 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。本基金2015年3月30日当日进行的上述相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深证证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2)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,暂不缴纳企业所得税。

3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣取税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;个人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,其中股权登记日在2015年9月8日之前的,暂减按25%计入应纳税所得额,股权登记日在2015年9月8日之后的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5)对于基金从事A股买卖,自2008年9月19日起,出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7 关联方关系

项目	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
全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	5,039,884,635.08	37.38%	3,834,409,792.19	52.12%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	1,425,675,908.19	29.05%	4,238,255,168.21	56.27%

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	10,298,400,000.00	52.10%	15,779,300,000.00	29.93%

7.4.8.1.4 权证交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

本基金本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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期佣金	占