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:2016年3月25日

兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

【2015】年度报告摘要

§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。

基金托管人招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	兴全轻资产混合(LOF)
场内简称	兴全轻资
基金主代码	163412
前端交易代码	163412
后端交易代码	163413
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年4月5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	985,309,567.85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	2012-05-31

注:自2015年8月7日起,本基金名称由"兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)"变更为"兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)"。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以挖掘"轻资产公司"为主要投资策略,力求获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	在大类资产配置上,本基金采取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;本基金运用多重指标因子,综合评估判断,选择优秀的轻资产公司进行投资;在行业配置上,除积极配置于那些在产品、服务以及业务属性上具有轻资产特征的行业。
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	本基金为混合型基金产品,属于较高风险、较高收益的基金品种,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

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	692,029,829.39	166,151,082.48	129,462,246.06
本期利润	863,017,642.32	171,046,100.67	116,057,875.67
加权平均基金份额本期利润	1.5760	0.2187	0.3003
本期基金份额净值增长率	101.66%	37.58%	38.45%
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	1.2071	0.6480	0.2684
期末基金资产净值	2,726,218,071.32	956,521,986.85	558,651,163.23
期末基金份额净值	2.767	1.922	1.397

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
过去三个月	35.70%	2.03%	13.77%	1.34%	21.93%	0.69%
过去六个月	17.79%	2.72%	-11.98%	2.14%	29.77%	0.58%
过去一年	101.66%	2.34%	7.36%	1.99%	94.30%	0.35%
过去三年	284.13%	2.05%	43.69%	1.43%	240.44%	0.62%
自基金合同生效起至今	287.59%	1.87%	47.85%	1.35%	239.74%	0.52%

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%×(沪深300指数t / 沪深300指数t-1)+20%×(中证国债指数t / 中证国债指数t-1)-1

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

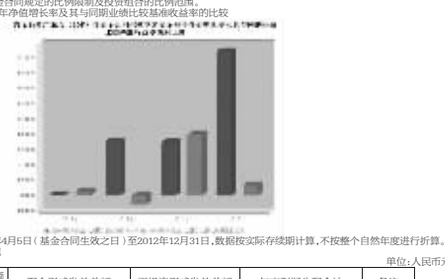
其中,t =1,2,3,…,T表示时间截至日。

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2015年12月31日。

2.按照《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2012年4月5日至2012年10月4日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基合同规定的比例限制,及投资组合的比例限制。

3.2.3 自基金合同生效以来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:2012年数据统计期间为2012年4月5日(基金合同生效之日)至2012年12月31日,数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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	10.640	1,371,317,284.34	102,327,163.99	1,473,644,448.33	—
2014	—	—	—	—	—
2013	—	—	—	—	—
合计	10.640	1,371,317,284.34	102,327,163.99	1,473,644,448.33	—

§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"。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、兴全静稳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)、兴全恒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)、兴全趋势投资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		
谢治宇	基金管理部投资副总监兼本基金、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理	2014年12月8日	-	7年	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。
陈扬帆	-	2012年4月5日	2015年1月5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、在职日期指基金合同生效之日(基金成立时因担任基金经理)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、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)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最大利益。管理人于2015年8月3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《兴业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、业绩评估等环节着把关,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A股市场经历了历史罕见的剧烈波动,而其中,货币政策、金融市场创新业务以及情绪预期等影响因素远远超过经济及个股基本面变化因素,因此给基金的操作和配置选股上带来了极大的挑战。回顾全年操作,本基金15年1季度主要减少了去年底以来上涨较多的金融地产的配置,增加了包括医药、消费以及成长相关的配置,布配提前是认为市场经历了14年下半年较长时间的上涨,部分行业可能有一定风险集聚,希望用均衡配置使得波动降低,但是实际效果看了这个判断略有偏差,15年1季度市场呈着偏向成长股,均衡配置的效果一般。15年2季度随着市场快速上涨,本基金重点减持了前期持有的部分已泡沫化的成长股,降低了仓位,进行上述操作的主要原因是认为市场上绝大多数公司的股价已呈现泡沫,实际效果看,6月市场短时间内出现了极大的跌幅,本基金操作上做好了应对市场风险的准备,二季度的潜值策略收益较为良好,较好的控制了基金的风险暴露。本基金在15年3季度总体保持不高的仓位,在控制风险的前提下适度参与反弹,持仓结构上,总体增加了包括消费、医药等长期品种的相关配置权重,在市场企稳后,阶段性增持了部分前期跌幅较大的互联网、农业等弹性品种,适度增加组合中弹性品种的权重,以期组合能更好的分享市场反弹的收益。在4季度中后期,本基金对成长股及传统蓝筹的持仓权重进行优化,操作主要基于市场经历了较长时间和较大幅度的反弹,部分公司再次进入泡沫区间,而低估值蓝筹品种本轮反弹较少,从价值相对角度具备较大吸引力,阶段性有望迎来较明显更好的相对收益机会,因此本季控制风险的原则,本基金在4季度中后期适度增加了低估值蓝筹类品种的仓位权重,以期降低后期波动。整体看,二季度以来的基金操作相对业绩比较基准获得了显著的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率101.66%,同期业绩比较基准收益率7.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年,实体经济改善预期难言乐观;资金面进一步宽松空间十分有限,需警惕流动性拐点;注册制实施,股票供给压力大于2015年;目前市场估值体值相不低,在此大背景下,2016年预期收益率应较今年有所降低,整体投资策略趋于谨慎。仍有如下影响因素值得关注,将成为本基金配置的主要指导基础:

(1)部分传统周期性行业,政策推动下行业供给收缩,有望带来企业盈利的边际改善。

(2)代表经济转型的方向性行业,如新消费、高端制造、农业现代化、信息产业等将有望获得政策与资本的持续推动,加速发展。

(3)前沿新兴科技不断涌现,相关领域必将成为资本关注的焦点。

(4)缺乏活力的传统旧经济领域,转型困难重重,或蕴藏较好的投资机会。

2016年本基金将密切关注上述可能存在的影响因素变化方向,在控制风险的原则下,力争降低波动,积极为投资者创造长期投资回报。

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。此外,在每个季度结束之后,公司监察稽核需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,以上报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,将公平交易同融资资金、同基金同时段下单、同一投资组合的不同投资策略等可能对结价造成影响的因素,并设计了相应的监控、保证交易的公平;(2)通过T检验、模拟利益输送金额,具体计算交易分析等方法,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《关于基金管理人公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限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查。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。

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》、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金实施利润分配1次,共分配利润1,473,644,448.33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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人一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 审计报告

财务报表是否经过审计	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P0563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:兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

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		244,524,800.11	43,672,851.11
结算备付金		10,514,226.91	6,852,747.89
存出保证金		1,457,113.62	985,575.86
交易性金融资产		2,478,068,122.26	893,872,473.57
其中:股票投资		2,327,341,480.56	893,872,473.57
基金投资		-	-
债券投资		150,716,641.70	-
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		-	-
应收证券清算款		-	25,971,186.39
应收利息		4,692,716.54	27,495.92
应收股利		-	-
应收申购款		31,954,397.58	4,526,718.44
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,771,201,371.02	975,909,049.18

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		-	-
应付证券清算款		28,052,820.68	-
应付赎回款		9,731,264.65	14,532,031.98
应付管理人报酬		3,026,282.68	1,398,799.16
应付托管费		504,380.44	233,133.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,263,275.90	3,055,918.13
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		405,275.35	167,179.89
负债合计		44,983,299.70	19,387,062.33
所有者权益:			
实收基金		985,309,567.85	497,709,141.94
未分配利润		1,740,908,503.47	458,812,844.91
所有者权益合计		2,726,218,071.32	956,521,986.85
负债和所有者权益总计		2,771,201,371.02	975,909,049.18

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值2.767元,基金份额总额985,309,567.85份。

7.2 利润表

会计主体:兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

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	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		904,039,204.43	212,605,449.06
1.利息收入		4,642,347.62	2,225,796.85
其中:存款利息收入		2,107,357.28	1,414,392.10
债券利息收入		2,532,197.33	562,874.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,792.41	248,469.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		713,921,873.50	199,025,242.88
其中:股票投资收益		705,302,715.58	195,497,583.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	495,448.02
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		8,619,157.92	3,032,211.54
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		170,987,812.93	4,895,018.19
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		14,487,170.68	6,459,421.14
减:二、费用		41,021,562.11	41,559,348.39
1、管理人报酬	7.4.2.1	20,132,917.19	20,565,836.57
2、托管费	7.4.2.2	3,355,486.11	3,427,639.35
3、销售服务费	7.4.2.3	-	-
4、交易费用		16,887,668.61	17,053,714.58
5、利息支出		187,054.21	33,823.37
其中:卖出回购金融资产支出		187,054.21	33,823.37
6、其他费用		458,435.99	478,334.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		863,017,642.32	171,046,100.67
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		863,017,642.32	171,046,100.67

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

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)	497,709,141.94	458,812,844.91	956,521,986.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	863,017,642.32	863,017,642.32
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)	487,600,425.91	1,892,222,464.57	2,379,822,890.48
其中:1.基金申购款	2,503,598,785.23	4,982,443,070.16	7,486,041,855.39
2.基金赎回款	-2,015,998,359.32	-3,089,720,605.59	-5,105,718,964.91
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)	-	-1,473,644,448.33	-1,473,644,448.33
五、期末所有者权益(基金净值)	985,309,567.85	1,740,908,503.47	2,726,218,071.32

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)	399,801,031.45	158,850,131.78	558,651,163.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	171,046,100.67	171,046,100.67
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)	97,908,110.49	128,916,612.46	226,824,722.95
其中:1.基金申购款	1,332,132,617.90	1,105,645,616.38	2,437,778,234.28
2.基金赎回款	-1,234,224,507.41	-976,729,003.92	-2,210,953,511.33
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)	497,709,141.94	458,812,844.91	956,521,986.85

注:本基金合同于2012年4月5日生效,本期数据按实际存续期计算。

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)(原名兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF),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[2011]2161号文《关于核准兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)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向社会公开发行募集,基金合同于2012年4月5日正式生效,首次设立募集规模为993,929,233.72份基金份额。本基金为契约型上市开放式,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2015年8月7日起更名为兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)。

本基金投资范围是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(包括创业板、中小板)以及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券、货币市场工具、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(但需符合中国证监会的相关规定)。

本基金为混合型基金,股票投资比例为基金资产的60%-95%,其中,符合轻资产理念的股票合计投资比例不低于股票资产的80%;债券投资比例为基金资产的5%-40%,其中本基金保留不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数+20%×中证国债指数。

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其相关规定以下简称"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[2006]103号文《关于证券投资基金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、深圳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《关于实施沪港股票市场交易互联互通机制有关税收政策的通知》、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税凭证当月或季度的次月15日内向其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

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
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	1,425,314,644.89	11.03%	2,687,094,815.11	21.28%

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

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交易。

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	22,600,000.00	5.86%	-	-

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。

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	1,302,267.88	13.93%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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	2,450,985.33	26.16%	1,280,168.27	41.89%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司海虹相关的费用(包括但不限于:交易(卖)经手费、证券结算风险基金和交(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。7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	20,132,917.19	20,565,836.57
其中:支付销售机构的客户维护费	4,442,923.38	6,673,820.26

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%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×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	3,355,486.11	3,427,639.35

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。

7.4.8.2.3 销售服务费

无。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 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
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	4,772,792.36	-
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	4,772,792.36	-
期末持有的基金份额占基金份额比例	0.4844%	-

注:1.期间申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额,期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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。

7.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.8.5 由