

# 兴业社会责任股票型证券投资基金

## 2008第四季度报告

2008年12月31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：二〇〇九年一月二十一日

## §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2009年01月15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2008年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

基金简称：	兴业社会责任基金
交易代码：	340007
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：	1,137,731,245.85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，同时强调上市公司的持续发展、法律、道德责任等方面履行的履行。

投资策略：本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略，将定量与定性研究相结合，在宏观经济与微观层面针对各类资产的价

值增长能力和稳定性进行综合评估，动态优化资产配置。在根据行业所

处的生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利

能力较好、持续发展能力强的行业的基础上，采用“兴业双层

行业筛选法”进行优化调整。采用“兴业社会责任四维选股模

型”精选股票。

业绩比较基准：80%×中债标普300指数+20%×中信标普国债指数

风险收益特征：较低风险、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：中国建设银行股份有限公司

## §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 2008年10月1日-2008年12月31日
1.本期已实现收益	-180,926,308.27
2.本期利润	-83,769,485.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0842
4.期末基金资产净值	884,956,982.34
5.期末基金份额净值	0.778

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。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	-7.16%	2.06%	-13.49%	2.40%	6.33%	-0.34%

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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图  
2008年4月30日至2008年12月31日

注：1、净值表现所取数据截至到2008年12月31日。

2、按照《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期

为2008年4月30日至2008年10月29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、本基金成立于2008年4月30日，截止2008年12月31日，本基金成立不满一年。

## §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
刘兆洋	本基金基金经理	2008-4-30	-	刘兆洋先生，1972年生，经济学博士。历任光大证券有限责任公司投资银行部经理、银华基金管理有限公司基金经理助理，兴业全球基金管理有限公司基金经理助理，兴业全球基金管理有限公司基金经理助理，兴业全球基金基金经理助理，研究策划部总监助理，兴业货币市场基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵循守信情况说明

本报告期内，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、《兴业社会责任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，基金管理人严格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，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，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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，兴业社会责任和兴业视野基金净值增长率差异不超过5%，业绩比较情况如下：

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较表

项目	本基金指标值⑥ (%)	公平指标值⑥ (%)
兴业社会责任	-7.16	-13.49
兴业视野	-11.44	-13.66

注：1、表中“本基金指标值”为“基金净值增长率”，“公平指标值”为“业绩比较基准增长率”。

2、兴业社会责任和兴业视野风格并非完全一致，兴业社会责任基金选股时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面履行的履行。兴业全球视野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。

3、10月，兴业社会责任还处在建仓期，股票投资比例相对比较低，在市场风险较大的时期承担了相对较低的系统性风险。为了排除建仓期的影响，我们比较了上述两只基金11月、12月的业绩，净值增长率的差距为1.15%。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

1、行情回顾及分析

四季度，在美国次贷危机和中国经济自身周期的影响下，中国经济增速迅速下降，股市和消费者对经济前景的担心与日俱增，降低开支。政府出台了多项应对措施，11月份国务院出台四万亿经济刺激扩大内需方案，中国人民银行宣布从2008年11月27日起，下调金融机构一年期人民币存贷款基准利率各108个基点，多项政策在一定程度上提振了市场人气，指数触底反弹。四季度上证指数下跌20.62%。

2、基金运作情况回顾

四季度，本基金继续保持谨慎的投资策略。四季度对持仓结构做了比较大的调整，增持了部分风险较低的股票品种，增持了部分09年业绩增长相对明确、估值低的股票，减持了部分行业萎缩、业绩下降的股票。基金在本季度的基金净值下跌

7.1 备查文件目录

1、中国证监会批准兴业社会责任股票型证券投资基金设立的文件

2、《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》

3、《兴业社会责任股票型证券投资基金托管协议》

4、《兴业社会责任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、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

7.2 存款账户

基金管理人、基金托管人的办公场所。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，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

二〇〇九年一月二十一日

# 兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

## 2008第四季度报告

2008年12月31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：二〇〇九年一月二十一日

## §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2009年01月16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2008年10月1日起至12月31日止。

## §2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金的过往业绩将显著高于2008年，随着经济短期的恢复，会带来周期性股票过度调整的纠错机会，但同时市场也必然会因对确定性增长给予充分的估值溢价，因此在持仓结构上我们将维持周期性股票和稳定类股票相对的平衡，在个股投资上更加偏重于自下而上的精选个股。

## §3 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,608,231,244.96	49.56%
其中：股票		7,608,231,244.96	49.56%
2	固定收益投资	6,913,588,031.79	45.03%
其中：债券		6,913,588,031.79	45.03%
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
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	660,317,072.06	4.30%
6	其他资产	170,390,945.30	1.11%
7	合计	15,352,527,294.11	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	1,077,663,470.99	7.05%
B	采掘业	2,207,023,258.98	14.44%
C	制造业	446,132,824.76	