

## 兴全趋势投资混合型证券投资基金 (场内简称)

## 2012 第二季度 报告

民國2年6月30日

序号	行业类别	公允价值源/元	占基金资产净值比例/元
1	医药、生物制品	1,111,111.11	1.11%

报告期末按行业分类的股票投资组合			
序号	行业类别	公允价值/元	占基金资产净值比例/%
粤	农林牧渔业	0.00	0.00%
月	采矿业	0.00	0.00%
悦	制造业	9,687,415.40	1.64%
悦	食品饮料	1,000,000.00	0.17%
悦	纺织服装业	0.00	0.00%
悦	木材造纸	0.00	0.00%
悦	医药生物	0.00	0.00%
悦	化学原料及塑料制品	0.00	0.00%
悦	电子	0.00	0.00%
悦	金属非金属	0.00	0.00%
悦	机械设备	0.00	0.00%
悦	医药生物制品	0.00	0.00%
悦	其他制造业	0.00	0.00%
悦	电力、热力及水的生产和供应业	0.00	0.00%
悦	建筑业	0.00	0.00%
悦	交通运输仓储业	0.00	0.00%
悦	信息技术业	0.00	0.00%
悦	批发和零售业	0.00	0.00%
悦	金融保险业	0.00	0.00%
悦	房地产业	0.00	0.00%
悦	社会服务业	0.00	0.00%
悦	传播与文化产业	0.00	0.00%
悦	综合类	0.00	0.00%

序号	股票代码	股票名称	数量增减	公允价值增减	占基金资产净值比例
----	------	------	------	--------	-----------

[illegible]

根据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					
序号	债券代码	债券名称	数量/张	公允价值/元	占基金资产净值比例/%
1	019008	浦发银行票据	浦发银行票据	浦发银行票据	浦发银行票据
2	019008	工商银行	工商银行	工商银行	工商银行
3	019008	石化转债	石化转债	石化转债	石化转债
4	019008	中广转债	中广转债	中广转债	中广转债

报告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  
基金本报告期末未持有权证。

6. 投资组合报告附注

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。

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

员	存出现金			3,000,000.00	3,000,000.00
圆	应收证券清算款				1,000,000.00
限	应收股利			1,000,000.00	1,000,000.00
源	应收利息			1,000,000.00	1,000,000.00
修	应收申购款			1,000,000.00	1,000,000.00
远	其他应收款				0.00
现	预付费用				0.00
其	其他				0.00
整	合计			1,000,000.00	1,000,000.00

续编资产负债表未有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值/账面	占基金资产净值比例
----	------	------	---------	-----------

国	国电南瑞	石化转债	国电南瑞公开发行可转债	国电南瑞
国	国电南瑞	中行转债	国电南瑞公开发行可转债	国电南瑞
源	国电南瑞	国电转债	国电南瑞公开发行可转债	国电南瑞
绿	绿庭转债	中海转债	绿庭转债公开发行可转债	绿庭转债
远	远成转债	深兴转债	远成转债公开发行可转债	远成转债
远	远成转债	巨轮转债	远成转债公开发行可转债	远成转债

报告期前末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值占期末公允价值比例	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
葛	000001	广发证券	流通股被冻结及质押受限	0.0002	非公开发行

除上述投资报告附注的其他文字描述部分无。

□ 开放式基金品种变动

单位：元

本报告期新增基金金额	0
本报告期基金总申购额	0
本报告期基金总赎回额	0
本报告期基金总申购份额	0
本报告期基金总赎回份额	0

[illegible]

民國22年6月30日

蘊約云)

报告期期末按行业分类的股票投资组合			
序号	行业类别	公允价值/元	占基金资产净值比例/%
粤	纺织服装业	1,000,000.00	0.02%
闽	采掘业	1,000,000.00	0.02%
悦	制造业	1,000,000.00	0.02%
悦凯	食品饮料	1,000,000.00	0.02%
悦凯	纺织服装业	1,000,000.00	0.02%
悦凯	木材家具	1,000,000.00	0.02%
悦凯	医药生物	1,000,000.00	0.02%

煤炭	石油 天然气 塑料 燃料	有色金属 黑色金属 非金属	化学原料及化学制品	医药
纺织	电子	金属 金属制品	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
陶瓷	金属 金属制品	有色金属 黑色金属 非金属	化学原料及化学制品	医药
橡胶	机械 设备 仪表	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
塑料制品	非金属 物品	有色金属 黑色金属 非金属	化学原料及化学制品	医药
纤维制品	其他制造业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
电力	电力 燃气 及水的生产和供应业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
建筑业	建筑业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
交通运输 业	交通 运输 业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
信息技术业	信息技术业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
批发和零售贸易	批发和零售贸易	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
金融 业	金融 业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
房地产业	房地产业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
社会服务业	社会服务业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
传播 与文化产业	传播 与文化产业	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
综合类	综合类	有色金属 黑色金属 非金属	橡胶 塑料制品 纤维及其制品	机械
	合计		有色金属 黑色金属 非金属	机械

序号	股票代码	股票名称	数量(万股)	公允价值(元)	公允价值占净值比例
四	上海浦东发展银行	浦发银行	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
五	中国工商银行	工商银行	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
六	中国建设银行	建设银行	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
七	交通银行	交通银行	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
八	招商银行	招商银行	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
九	广发证券	广发证券	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
十	五粮液	五粮液	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%
十一	青岛啤酒	青岛啤酒	1,500,000,000	1,500,000,000.00	1.00%



源	员是源源源	中时转债			
绿	员是源源国	价值西债			

(注)报告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

报告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  
基金本报告期末未持有权证。

6. 投资组合报告附注

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。

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

员	存出现金			3,000,000.00	3,000,000.00
圆	应收证券清算款				1,000,000.00
限	应收股利			1,000,000.00	1,000,000.00
源	应收利息			1,000,000.00	1,000,000.00
修	应收申购款			1,000,000.00	1,000,000.00
远	其他应收款				0.00
现	预付费用				0.00
其	其他				0.00
整	合计			1,000,000.00	1,000,000.00

续编资产负债表未有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值/账面	占基金资产净值比例
----	------	------	---------	-----------

国	国电南瑞	石化转债	国电南瑞公开发行可转债	国电南瑞
国	国电南瑞	中行转债	国电南瑞公开发行可转债	国电南瑞
源	国电南瑞	国电转债	国电南瑞公开发行可转债	国电南瑞
绿	绿庭转债	中海转债	绿庭转债公开发行可转债	绿庭转债
远	远成转债	深兴转债	远成转债公开发行可转债	远成转债
远	远成转债	巨轮转债	远成转债公开发行可转债	远成转债

报告期前末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值占期末公允价值比例	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
葛	000001	广发证券	流通股被冻结及质押受限	0.0002	非公开发行

除上述投资报告附注的其他文字描述部分无。

□ 开放式基金品种变动

单位：元

本报告期新增基金金额	0
本报告期基金总申购额	0
本报告期基金总赎回额	0
本报告期基金总申购份额	0
本报告期基金总赎回份额	0

本期新增基金份额变动比例		基金管理人
本报告期末基金份额总额		本基金存续期间基金份额总额
注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。		
(四)影响投资者决策的其他重要信息		
<b>(五)其他备查文件目录</b>		
<p>1. 中国证监会批准本基金设立的文件</p> <p>2. 中国证券投资基金业协会证券投资基金备案(《基金合同》)</p> <p>3. 中国证券投资基金业协会证券投资基金备案(《基金托管协议》)</p> <p>4. 深圳证券交易所证券投资基金上市交易(《深圳证券交易所上市公告书》)</p> <p>5. 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程</p> <p>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</p> <p>7. 基金存放地点</p> <p>8. 基金管理人、基金托管人办公场所</p> <p>9. 基金网站网址</p> <p>投资者可登录基金管理人互联网网站(鹏华基金信息披露网站)或在营业时间内至基金管理人、基金管理人办公场所或销售机构处查阅。</p>		
兴业全球基金管理有限公司 营销中心 昆明		

民國22年6月30日

报告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	占基金资产净值比例
----------------------------------	-----------

序号	国券代码	国券名称	双盟认购地	公允价认购地	认购金额
1	0100000001	0100000001	0100000001	0100000001	0100000001

续前报告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  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

续前报告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。

截至报告期末,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。

截至报告期末,本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

截至报告期末,本基金其他资产构成

序号	名称	金额/占比
1	存出保证金	1,000,000.00

國	應收證券清算款	應收證券清算款
猿	應收股利	應收股利
源	應收利息	應收利息

[illegible]

本报告期基金拆分变动份额		原
本报告期末基金份额总额		报告期结束前最后一个交易日的基金份额总额

影响投资决策的其他重要信息。

无。

**筹备文件目录**

**准备各文件目录**

① 中国证监会批准本基金设立的文件。

② 中国社会责任股票型证券投资基金合同书。

③ 中国社会责任股票型证券投资基金托管协议。

④ 中国社会责任股票型证券投资基金招募说明。

⑤ 基金管理人业务资格批文、营业执照和公司章程。

⑥ 本基金首次在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

**现有地点**

基金管理人、基金托管人的办公场所。

**投资运作方式**

投资于经国家基金管理人互联网站 [http://www.xqfunds.com.cn](#) 查询，或在投资时间内至基金管理人、基金管理人办公处免费查阅。

兴业全球基金管理有限公司

序号	债券品种	公允价值/元	占基金资产净值比例/元
1	国家债券		

国	央行票据	原	原
债	金融债券	原	原
	其中政策性金融债	原	原
源	企业债券	原	原
绿	企业短期融资券	原	原
远	中期票据	原	原

原	可转债				原	原		
原	其他				原	原		
原	合计				原	原		
基金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								
序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)			
1	国债逆回购	国债逆回购	(金额)					
本报告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								
本基金本报告期末未持有资产支持证券。								
本报告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。								
投资组合报告附注								
本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现监管部门立案调查,并且未在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。								
本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。								
其他资产构成								
序号	名称			金额(元)				

资产	货币资金	原	流动资产	流动资产	流动资产
	应收账款	原	流动资产	流动资产	流动资产
	应收票据	原	流动资产	流动资产	流动资产
	预付款项	原	流动资产	流动资产	流动资产
	应收利息	原	流动资产	流动资产	流动资产
	应收股利	原	流动资产	流动资产	流动资产
	其他应收款	原	流动资产	流动资产	流动资产
	坏账准备	原	流动资产	流动资产	流动资产
	其他流动资产	原	流动资产	流动资产	流动资产
负债	应付账款	原	流动负债	流动负债	流动负债
	应付票据	原	流动负债	流动负债	流动负债
	应付利息	原	流动负债	流动负债	流动负债
	应付股利	原	流动负债	流动负债	流动负债
	其他应付款	原	流动负债	流动负债	流动负债
	预收款项	原	流动负债	流动负债	流动负债
	应付职工薪酬	原	流动负债	流动负债	流动负债
	应交税费	原	流动负债	流动负债	流动负债
	其他流动负债	原	流动负债	流动负债	流动负债
所有者权益	实收资本	原	非流动负债	非流动负债	非流动负债
	资本公积	原	非流动负债	非流动负债	非流动负债
	盈余公积	原	非流动负债	非流动负债	非流动负债
	未分配利润	原	非流动负债	非流动负债	非流动负债
	其他所有者权益	原	非流动负债	非流动负债	非流动负债
合计		原	非流动负债	非流动负债	非流动负债

注：本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末持有的处于转股期的可转换债券

注：本报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允	占基金资产净值	流通受限情况说明
			价值	比例(%)	
		广发证券			基金公开发行

<p>无。除投资组合报告附注的其他文字描述部分无。</p>	
<p>§2 开放式基金份额变动</p>	
<p>单位:份</p>	
本报告期期初基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期基金份额总申购份额	1,000,000,000.00
本报告期基金份额总赎回份额	1,000,000,000.00
本报告期基金份额净变动份额	0.00
本报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00
<p>注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。影响投资者决策的其他重要信息</p>	
<p>附录五 文件目录</p>	

