兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）

2012 第二季度 报告

[illegible]年6月30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
报告送出日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资股票
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
前端交易代码	[illegible]
后端交易代码	[illegible]
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业或公司真以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，争实现当期投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在大类资产配置上，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；在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置；运用[illegible]绿色投资筛选策略，在[illegible]的基础上，采用环境因子与公司财务等基本面因子相结合，进行综合评估筛选，选出那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
业绩比较基准	[illegible]沪深[illegible]指数[illegible]沪证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§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[illegible]年[illegible]月[illegible]日-[illegible]年[illegible]月[illegible]日
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

注：1)、2)、3)、4)、5)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（含公允价值变动收益）减除相关费用后的余额；3)、4)本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

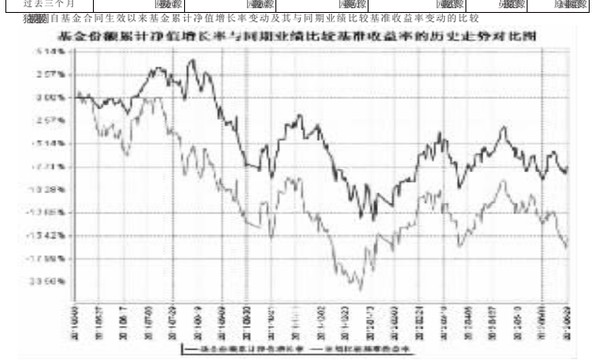
[illegible]所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§4 基金净值表现

§4.1 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	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

§4.2 自基金合同生效以来基金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：图示净值表现所取数据截至到[illegible]年[illegible]月[illegible]日。

[illegible]按照[illegible]兴全绿色投资股票型证券投资基金合同[illegible]的规定，本基金建仓期为[illegible]年[illegible]月[illegible]日至[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

§5 管理人报告

§5.1 基金经理[illegible]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
		任职日期	离任日期		
傅鹏博	基金管理部副总监兼本基金和兴全社会责任股票型证券投资基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]	[illegible]年生，[illegible]经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师，[illegible]银万国证券股份有限公司企业融资部经理；[illegible]方证券股份有限公司资产管理部负责人；[illegible]研究所首席策略师/工业富基金管理有限公司首席策略师。
陈锦泉	本基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]	[illegible]年生，[illegible]金融学学士。历任职华安证券[illegible]名为安徽证券[illegible]证券投资总部投资经理；[illegible]安保险资产运营中心高级组合经理；[illegible]安资产管理公司投资管理部副总经理。

注：[illegible]职务指截止报告期末的职务。[illegible]报告期末仍在任的，[illegible]离任前的职务。[illegible]报告期内离任的，[illegible]任职日期指基金合同生效之日。[illegible]基金成立时即担任基金经理，[illegible]公司作出聘任决定之日。[illegible]基金成立后担任基金经理，[illegible]离任日期指公司作出解聘决定之日。

[illegible]证券从业年限，按其从事证券投资、[illegible]研究等业务的年限计算。

§5.2 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，[illegible]基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》、[illegible]及其各项实施细则、[illegible]兴全绿色投资股票型证券投资基金合同[illegible]及其他相关法律法规的规定，[illegible]秉诚实信用、[illegible]勤勉尽责、[illegible]信于市场、[illegible]信于社会的原则管理和运用基金资产，[illegible]的基金份额持有人谋求最大利益。[illegible]报告期内，[illegible]基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，[illegible]违法违规、[illegible]履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

§5.3 公平交易专项说明

§5.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，[illegible]基金管理人严格按照《证券投资基金法》、[illegible]《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、[illegible]公司相关制度等规定，[illegible]投资授权、[illegible]研究分析、[illegible]投资决策、[illegible]交易执行、[illegible]绩评估等环节严格把关，[illegible]保各投资组合之间得到公平对待，[illegible]护投资者的合法权益。[illegible]司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，[illegible]从不同的角度分析差异的来源，[illegible]察是否存在非公平的因素。

§5.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，[illegible]有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的[illegible]的情况，[illegible]发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

§5.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

§5.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本季度，[illegible]股经历了小幅反弹之后的调整，[illegible]场在经济数据增速下滑和上市公司业绩下滑面前，[illegible]体表现较为疲弱。[illegible]这种格局下，[illegible]基金尽管在仓位基本保持了[illegible]性水平，[illegible]在行业上，[illegible]向防御[illegible]前组合主要集中在食品饮料、[illegible]药、[illegible]医疗、[illegible]融、[illegible]能、环保[illegible]力这几个行业上。降低了银行、[illegible]设备和商业的投资。[illegible]季度，[illegible]我们在一季度降低了医药的投资，[illegible]是在二季度开始，[illegible]我们对医药的投资价值进行重新了评估，[illegible]幅增加了投资。[illegible]外，在二季度，[illegible]于对煤炭价格调整的判断，[illegible]我们开始认同火电企业的投资价值，[illegible]择了沿海火电进行了重点投资。[illegible]思一季度，[illegible]我们对组合中重仓股进行了深刻检讨，[illegible]积极进行了调整。[illegible]体上表，[illegible]季度的超额收益主要来源于行业[illegible]股方面仍需提高。

§5.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，[illegible]基金净值增长率为[illegible]，[illegible]同期业绩比较基准收益率为[illegible]。

§5.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政府当前稳增长措施并不能明显改变当前经济下滑态势，[illegible]我市场对经济前景担忧程度加剧，[illegible]期类股票受到抛弃，[illegible]御类股票和成长股成为资金追捧的对象。[illegible]种现象导致市场只是存在结构性机会。[illegible]基金仍将坚持大消费[illegible]体现[illegible]力三个大结构方向，[illegible]时度外[illegible]态调整[illegible]仓位配置上继续保持中性观点。[illegible]重结构和选股上，[illegible]我们依旧认为，在经济转型中，[illegible]有管理优势和财务状况良好的企业更容易脱颖而出。

§6 投资组合报告

§6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
2	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	原	原
3	金融衍生品投资	原	原
4	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
5	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
6	其他资产	[illegible]	[illegible]
7	合计	[illegible]	[illegible]

§6.2 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	原	原
B	采掘业	[illegible]	[illegible]
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
C1	纺织、服装、皮毛	原	原
C2	木材、家具	原	原
C3	造纸、印刷	原	原
C4	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
C5	电子	原	原
C6	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
C7	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
C8	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
C99	其他制造业	原	原
D	电力、煤气及水的生产和供应业	[illegible]	[illegible]
E	建筑业	原	原
F	交通运输、仓储业	[illegible]	[illegible]
G	信息技术业	[illegible]	[illegible]
H	批发和零售贸易	[illegible]	[illegible]
I	金融、保险业	[illegible]	[illegible]
J	房地产业	原	原
K	社会服务业	[illegible]	[illegible]
L	传播与文化产业	[illegible]	[illegible]
M	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

§6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	双汇发展	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	广发证券	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	中牧股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	五粮液	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	招商银行	[illegible]	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	格力电器	[illegible]	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	上海机场	[illegible]	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	用友软件	[illegible]	[illegible]	[illegible]
9	[illegible]	海正药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
10	[illegible]	粤电力B	[illegible]	[illegible]	[illegible]

§6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	原	原
2	央行票据	[illegible]	[illegible]
3	金融债券	原	原
	其中：政策性金融债	原	原
4	企业债券	原	原
5	企业短期融资券	原	原
6	中期票据	原	原
7	可转债	原	原
8	其他	原	原
9	合计	[illegible]	[illegible]

§6.5 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

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	[illegible]	[illegible]央行票据[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	[illegible]央行票据[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

§6.6 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。

§6.7 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。

§6.8 投资组合报告附注

§6.8.1 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，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

§6.8.2 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。

§6.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	[illegible]
2	应收证券清算款	原
3	应收股利	原
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	[illegible]
6	其他应收款	原
7	待摊费用	原
8	其他	原
9	合计	[illegible]

§6.8.4 报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§6.8.5 报告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。

§6.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

§9.1 备查文件目录

§9.1.1 中国证监会批准本基金设立的文件。

§9.1.2 兴全绿色投资股票型证券投资基金[illegible]基金合同。

§9.1.3 兴全绿色投资股票型证券投资基金[illegible]托管协议。

§9.1.4 兴全绿色投资股票型证券投资基金[illegible]新招募说明书。

§9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。

§9.1.6 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。

§9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

§9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站[illegible]，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
[illegible]年[illegible]月[illegible]日

兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）

2012 第二季度 报告

[illegible]年6月30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
报告送出日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日（基金合同生效日）至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全轻资产投资股票
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
前端交易代码	[illegible]
后端交易代码	[illegible]
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	本基金以挖掘[illegible]轻资产公司的主要投资策略，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，按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	[illegible]沪深[illegible]指数[illegible]沪证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，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混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§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[illegible]年[illegible]月[illegible]日-[illegible]年[illegible]月[illegible]日
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

注：1)、2)、3)、4)、5)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（含公允价值变动收益）减除相关费用后的余额；3)、4)本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

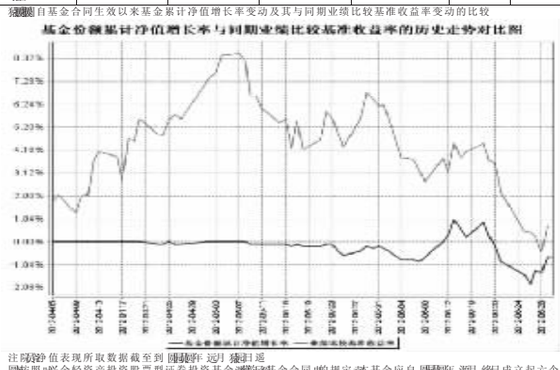
[illegible]所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

§4 基金净值表现

§4.1 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
[illegible]年[illegible]月[illegible]日-[illegible]年[illegible]月[illegible]日（基金合同生效日至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止）	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

§4.2 自基金合同生效以来基金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：图示净值表现所取数据截至到[illegible]年[illegible]月[illegible]日。

[illegible]按照《兴全轻资产投资股票型证券投资基金合同》的规定，本基金应自[illegible]年[illegible]月[illegible]日成立起六个月内，达到本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。截止本基金成立于[illegible]年[illegible]月[illegible]日，[illegible]本基金成立不满一年。

§5 管理人报告

§5.1 基金经理[illegible]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
		任职日期	离任日期		
陈扬帆	本基金和兴全有机增长混合型证券投资基金基金经理	[illegible]年[illegible]月[illegible]日	原	[illegible]	[illegible]年生，[illegible]商管理硕士。历任北京宏基兴业技术有限公司副总经理；[illegible]海奥盛投资有限公司总经理；[illegible]兴业全球基金管理有限公司兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理助理。

注：[illegible]职务指截止报告期末的职务。[illegible]报告期末仍在任的，[illegible]离任前的职务。[illegible]报告期内离任的，[illegible]任职日期指基金合同生效之日。[illegible]基金成立时即担任基金经理，[illegible]公司作出聘任决定之日。[illegible]基金成立后担任基金经理，[illegible]离任日期指公司作出解聘决定之日。

[illegible]证券从业年限，按其从事证券投资、[illegible]研究等业务的年限计算。

§5.2 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，[illegible]基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》、[illegible]及其各项实施细则、[illegible]兴全轻资产投资股票型证券投资基金合同》及其他相关法律法规的规定，[illegible]秉诚实信用、[illegible]勤勉尽责、[illegible]信于市场、[illegible]信于社会的原则管理和运用基金资产，[illegible]的基金份额持有人谋求最大利益。[illegible]报告期内，[illegible]基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，[illegible]违法违规、[illegible]履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

§5.3 公平交易专项说明

§5.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，[illegible]基金管理人严格按照《证券投资基金法》、[illegible]《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、[illegible]公司相关制度等规定，[illegible]投资授权、[illegible]研究分析、[illegible]投资决策、[illegible]交易执行、[illegible]绩评估等环节严格把关，[illegible]保各投资组合之间得到公平对待，[illegible]护投资者的合法权益。[illegible]司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，[illegible]从不同的角度分析差异的来源，[illegible]察是否存在非公平的因素。

§5.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，[illegible]有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的[illegible]的情况，[illegible]发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

§5.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

§5.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

轻资产基金成立于今年[illegible]月，[illegible]我一个份额就是一份信任，我们深感责任重大。基于市场两三个月内都难以有系统性的向上行情的判断，[illegible]时我们也希望建仓期内尽可能控制净值的向下波动的风险，[illegible]此我们确立了稳健起步的原则：谨慎为先，[illegible]步建仓。[illegible]在回头看，[illegible]上旬的市场确处于一个月度行情的中低位，[illegible]作为一只新成立的基金，[illegible]在市场并无系统性向上的机会的判断下的确不宜做出为短期或有上涨而迅速大规模建仓的举动。

在轻资产基金的管理上，我们希望能多一些绝对收益的意识和做法，[illegible]是为持有人获取较低风险暴露下的实实在在的收益。[illegible]这是我们过去三个月管理轻资产基金的心中愿景，也是下一阶段的行动指南。

§5.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，[illegible]基金净值增长率为[illegible]，[illegible]同期业绩比较基准收益率为[illegible]。

§5.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末，方面国内经济增速下行，[illegible]一方面流动性渐趋宽松，[illegible]者交织的态势更加明显，[illegible]势下行和结构性行情活跃并存是上述状况在证券市场中的映射。我们认为，[illegible]济着陆会是慢着陆，[illegible]结构必然对应增速降低，[illegible]此，我们不应过高预期经济迅速恢复，[illegible]应寄希望于再次四万亿式的政策强烈刺激，[illegible]于经济展望是“战”还是“逃”的不同判断决定了投资者对大势的判断以及对周期和消费不同偏好。[illegible]场在大多数时候是正确的，[illegible]我们既要承认市场业已反映的这种现象的合理性，[illegible]更注意观察这种趋势持续的可能性。

行业层面上，我们对大多数依靠投资拉动的周期行业保持谨慎态度：我们长期看好社会富裕带来的投资机会，[illegible]段性看好政策可能重点扶持的行业；但从根本上说，我们还是最注重成长确定的行业和个股。[illegible]以在预期未来连续两年[illegible]以上增长的公司不可胜数，[illegible]今年这样的公司却偏然减少，[illegible]其中估值合理者也就愈显其珍贵了。

§6 投资组合报告

§6.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：股票	[illegible]	[illegible]
2	固定收益投资	[illegible]	[illegible]
	其中：债券	[illegible]	[illegible]
	资产支持证券	原	原
3	金融衍生品投资	原	原
4	买入返售金融资产	原	原
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	原	原
5	银行存款和结算备付金合计	[illegible]	[illegible]
6	其他资产	[illegible]	[illegible]
7	合计	[illegible]	[illegible]

§6.2 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	原	原
B	采掘业	原	原
C	制造业	[illegible]	[illegible]
C0	食品、饮料	[illegible]	[illegible]
C1	纺织、服装、皮毛	原	原
C2	木材、家具	原	原
C3	造纸、印刷	原	原
C4	石油、化学、塑胶、塑料	[illegible]	[illegible]
C5	电子	原	原
C6	金属、非金属	[illegible]	[illegible]
C7	机械、设备、仪表	[illegible]	[illegible]
C8	医药、生物制品	[illegible]	[illegible]
C99	其他制造业	原	原
D	电力、煤气及水的生产和供应业	原	原
E	建筑业	原	原
F	交通运输、仓储业	原	原
G	信息技术业	原	原
H	批发和零售贸易	原	原
I	金融、保险业	原	原
J	房地产业	[illegible]	[illegible]
K	社会服务业	原	原
L	传播与文化产业	原	原
M	综合类	原	原
	合计	[illegible]	[illegible]

§6.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	[illegible]	海康威视	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	大华股份	[illegible]	[illegible]	[illegible]
3	[illegible]	承德露露	[illegible]	[illegible]	[illegible]
4	[illegible]	新华保险	[illegible]	[illegible]	[illegible]
5	[illegible]	沱牌舍得	[illegible]	[illegible]	[illegible]
6	[illegible]	同仁堂	[illegible]	[illegible]	[illegible]
7	[illegible]	云南白药	[illegible]	[illegible]	[illegible]
8	[illegible]	江中药业	[illegible]	[illegible]	[illegible]
9	[illegible]	陕国投B	[illegible]	[illegible]	[illegible]
10	[illegible]	三特索道	[illegible]	[illegible]	[illegible]

§6.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	原	原
2	央行票据	[illegible]	[illegible]
3	金融债券	原	原
	其中：政策性金融债	原	原
4	企业债券	原	原
5	企业短期融资券	原	原
6	中期票据	原	原
7	可转债	原	原
8	其他	原	原
9	合计	[illegible]	[illegible]

§6.5 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

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	[illegible]	[illegible]央行票据[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]
2	[illegible]	[illegible]央行票据[illegible]	[illegible]	[illegible]	[illegible]

§6.6 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。

§6.7 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。

§6.8 投资组合报告附注

§6.8.1 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，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

§6.8.2 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。

§6.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	[illegible]
2	应收证券清算款	原
3	应收股利	原
4	应收利息	[illegible]
5	应收申购款	[illegible]
6	其他应收款	原
7	待摊费用	原
8	其他	原
9	合计	[illegible]

§6.8.4 报告期持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§6.8.5 报告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。

§6.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（[illegible]年[illegible]月[illegible]日）基金份额总额	[illegible]
本报告期基金总申购份额	[illegible]
减：本报告期基金总赎回份额	[illegible]
本报告期基金拆分变动份额	原
本报告期期末基金份额总额	[illegible]

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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

§9.1 备查文件目录

§9.1.1 中国证监会批准本基金设立的文件。

§9.1.2 兴全轻资产投资股票型证券投资基金[illegible]基金合同。

§9.1.3 兴全轻资产投资股票型证券投资基金[illegible]托管协议。

§9.1.4 兴全轻资产投资股票型证券投资基金[illegible]新招募说明书。

§9.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程。

§9.1.6 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。

§9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

§9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站[illegible]，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
[illegible]年[illegible]月[illegible]日

兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

2012 第二季度 报告

[illegible]年6月30日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：[illegible]年[illegible]月[illegible]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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于[illegible]年[illegible]月[illegible]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[illegible]年[illegible]月[illegible]日起至[illegible]年[illegible]月[illegible]日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全沪深300指数增强
基金主代码	[illegible]
交易代码	[illegible]
前端交易代码	[illegible]
后端交易代码	[illegible]
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	[illegible]年[illegible]月[illegible]日
报告期末基金份额总额	[illegible]
投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，通过指数复制的方法拟合沪深300指数，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。基金力争日均跟踪误差不超过[illegible]，年跟踪误差不超过[illegible]，日均下方跟踪误差不超过[illegible]，年下方跟踪误差不超过[illegible]。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，通过指数复制的方法拟合沪深300指数，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。
业绩比较基准	沪深300指数[illegible]国债存款利率[illegible]
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深300指数所代表的市场平均收益。股票基金中处于中等风险水平的基金产品。
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司

§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[illegible]年[illegible]月[illegible]日-[illegible]年[illegible]月[illegible]日
1.本期已实现收益	[illegible]
2.本期利润	[illegible]
3.加权平均基金份额本期利润	[illegible]
4.期末基金资产净值	[illegible]
5.期末基金份额净值	[illegible]

注：1)、2)、3)、4)、5)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）减除相关费用后的余额；3)、4)本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

[illegible]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