兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013年9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:2013年10月25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2013年10月24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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资股票(LOF)
基金主代码	163409
交易代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	1,052,193,562.12份
投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业或公司,以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会,力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。在运用"绿色投资筛选策略"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,对那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	99,344,125.32
2.本期利润	251,211,439.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.2243
4.期末基金资产净值	1,322,045,873.64
5.期末基金份额净值	1.256

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。

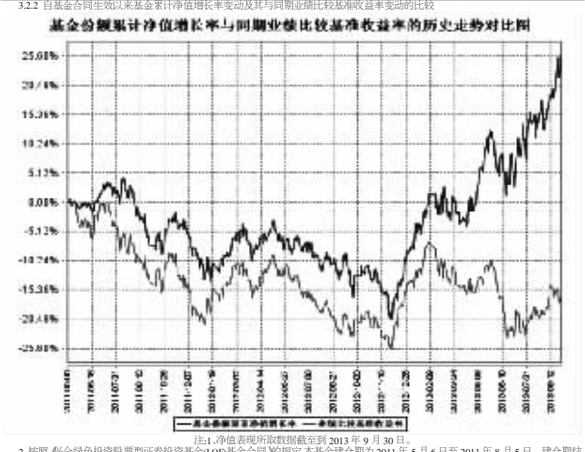
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	21.71%	1.48%	7.22%	1.14%	14.49%	0.34%

3.2.2 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:1.净值表现所取数据截至到2013年9月30日。

2.按照《兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2011年5月6日至2011年8月5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。

§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
		任职日期	离任日期		
陈锦泉	本基金基金经理	2011年5月6日	-	14年	1977年生,工商管理硕士。历任职华安证券(原名为安徽证券)证券投资总部投资经理,平安保险资产运营中心高级组合经理,平安资产管理公司投资管理部副总经理。

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(基金成立时即担任基金经理)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、《兴全绿色投资股票型证券投资基金(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求最大利益。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 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,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。公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,从不同的角度分析差异的来源,考察是否存在非公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所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5%的情况,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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

半年报说到"型宏观经济二次探底,投资前景低迷,资金从过剩产能行业的撤出,乐观预见资本市场会出现流动性偏正面的情景",尽管做判断时底气不足,但是从三季度沪深300和创业板都出现了指数上涨和成交活跃的表现看,这个判断总体正确。三季度,代表未来的新兴产业以及自贸区相关股票表现优异。本基金持有的自动化装备、移动互联网、智能医疗、医疗器械和光伏等板块表现良好,为基金带来了丰硕的收益。

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21.71%,同期业绩比较基准收益率为7.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年创业板是半市,沪深300是平衡市,大局基本改变不了了。今年主题投资盛行,局部泡沫的特点非常明显,尽管流动性充裕能够解释部分因素,但是我们必须清醒地看到其中部分的投机和泡沫成分。展望四季度,我们认为对市场存在回归理性的可能,但是在整个经济转型的大背景下,那些代表经济转型发展方向的行业和具有创新能力的公司会穿越周期,因此对调整的过度担忧同样是不可取的。本基金管理人目前的主要策略是逐渐为明年进行布局,侧重未来成长,选股不必拘泥于行业。

§5 投资组合报告

5.1 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	1,171,411,510.36	87.50
	其中:股票	1,171,411,510.36	87.50
2	固定收益投资	73,716,966.00	5.51
	其中:债券	73,716,966.00	5.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	3.73
	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	36,109,792.16	2.70
6	其他资产	7,536,897.22	0.56
7	合计	1,338,775,165.74	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	828,594,216.04	62.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,004,754.80	3.03
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	124,849,863.83	9.44
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,246,450.86	6.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,425,000.00	2.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	48,791,224.83	3.69
N	水利、环境和公共设施管理业	14,500,000.00	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,171,411,510.36	88.61

5.3 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	002024	苏宁云商	8,620,419	110,772,384.15	8.38
2	300124	汇川技术	1,958,870	97,688,846.90	7.39
3	600835	上海机电	4,600,000	72,910,000.00	5.51
4	600872	中炬高新	5,777,436	57,889,908.72	4.38
5	002308	威创股份	5,890,307	54,603,145.89	4.13
6	300012	华测检测	2,848,291	48,791,224.83	3.69
7	601126	四方股份	2,633,718	48,355,062.48	3.66
8	600089	特变电工	3,789,988	45,745,155.16	3.46
9	300289	利德曼	1,239,567	42,455,169.75	3.21
10	002202	金风科技	5,559,998	39,031,185.96	2.95

5.4 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	54,346,966.00	4.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,370,000.00	1.47
	其中:政策性金融债	19,370,000.00	1.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	73,716,966.00	5.58

5.5 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	130007	13附息国债07	400,000	39,836,000.00	3.01
2	130205	13国开05	200,000	19,370,000.00	1.47
3	130014	13附息国债14	100,000	10,002,000.00	0.76
4	010303	03国债(3)	46,900	4,508,966.00	0.34

5.6 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。

5.7 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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,154,155.24
2	应收证券清算款	4,440,029.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,304,402.88
5	应收申购款	638,309.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,536,897.22

5.10.4 报告期末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可转换债券。

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,206,856,723.46
报告期期间基金总申购份额	37,469,336.09
减:报告期期间基金总赎回份额	192,132,497.43
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期末基金份额总额	1,052,193,562.12

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§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

1、中国证监会批准本基金设立的文件

2、《兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金合同》

3、《兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)托管协议》

4、《兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书》

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。

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(http://www.xyfunds.com.cn)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
2013年10月25日

兴全合润分级股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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:2013年10月25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2013年10月24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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全合润分级股票
基金主代码	163406
交易代码	163406
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月22日
报告期末基金份额总额	807,495,397.32份
投资目标	本基金通过定量与定性相结合精选股票,以追求当期收益与实现长期资本增值。
投资策略	本基金以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。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。
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	本基金为股票型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险、较高收益的基金品种。
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

下属三级基金的基金简称	兴全合润分级股票	合润A	合润B
下属三级基金的交易代码	163406	150016	150017
报告期末下属三级基金的份额总额	754,588,541.32份	21,162,742.00份	31,744,114.00份

§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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	32,094,070.03
2.本期利润	115,361,573.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.1257
4.期末基金资产净值	917,691,955.64
5.期末基金份额净值	1.1365

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。

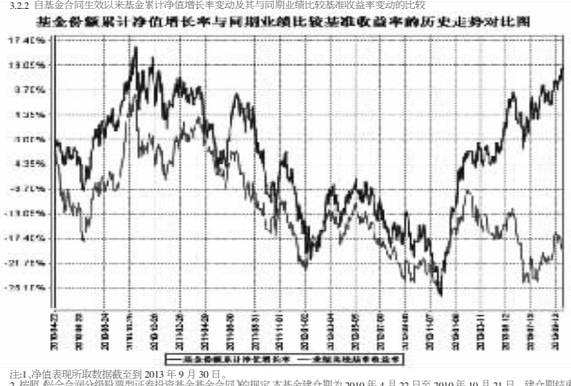
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.15%	0.94%	7.22%	1.14%	4.93%	-0.20%

3.2.2 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:1.净值表现所取数据截至到2013年9月30日。

2.按照《兴全合润分级股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21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。

§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
		任职日期	离任日期		
谢治宇	本基金基金经理	2013年1月29日	-	5年	1981年生,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。

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(基金成立时即担任基金经理)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、《兴全合润分级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 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,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。公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,从不同的角度分析差异的来源,考察是否存在非公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,所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5%的情况,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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在二季度中,市场持续的表现出了结构性的趋势。一方面,以传媒为代表的TMT板块持续取得超额收益,自贸区、民营银行等主题此起彼伏,创业板指屡创新高;另一方面银行地产为代表的周期行业没有任何起色。本质上来说,市场对于中国经济转型的预期十分强烈。结合今年融资资金的入场,形成了近年来很少一见的结构性牛市的行情。

在三季度的操作中,合润基金基本保持了之前的持仓。应该说还是错过了三季度的部分机会。但是市场对于新兴产业的追捧是否已经到了泡沫的程度,我们还是存在疑虑的。

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12.15%,同期业绩比较基准收益率为7.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们倾向于对今年四季度股票市场持谨慎态度。

四季度政策上的不确定性相对较高,市场对于制度改革,例如自贸区、土地改革、国企改革、金融改革等已经有所反映。结合PMI、进口、汽车地产销量、库存、发电量等信息来看,我们预期今年三、四季度经济增长大概率保持稳定,整个经济增长的平台将高于今年上半年。在经济增长没有较大减速的情况下,后续将出台积极性财政政策的可能性大幅降低。另一方面,IPO可能在十八届三中全会后重启,新股目前排队家数约750家,融资压力巨大,新股发行将对现有资金构成分流。根据媒体报道,新股发行制度改革的方向可能包含了存量配售、批量发行、再融资审批权下放等,对于市场的影响偏利空。

从经济基本面来看,7、8月份PMI有所反弹,根据9月份的PMI价格指数,9月份PPI可能仍在反弹。企业利润与价格的走势通常一致,企业盈利可能好于预期。但是基于库存周期的波动,我们预计经济反弹的动量将减弱。三季度初期库存水平异常低,库存周期是三季度工业生产大幅反弹的一个重要推动力。四季度初,库存水平属于正常,补库存的动量减弱。加之去年四季度经济数据的基数较高,因此我们预期经济增长的同比增速可能较三季度略有下降。

海外市场对于国内的影响也偏负面。九月份虽然美联储超预期的拖延了缩减QE的时点,但新兴市场对于该事件的反应异常短暂。十月中旬和十二月底召开的美联储会议均有可能宣布削减QE规模,因此四季度不宜对于新兴市场的资金流入抱有过高的期望。同时临近年末,在央行没有刻意压低利率水平的前提下,资金面通常出现季节性紧张。

综上所述,我们将适度降低仓位,规避四季度市场调整的风险。行业配置上,我们偏向于两类投资机会。一类是受益于政策支持的行业,例如节能环保、配电网建设、光伏、金融等行业。另一个是业绩稳定、防御类的行业,例如医药、食品饮料。

§5 投资组合报告

5.1 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	774,209,857.22	83.57
	其中:股票	774,209,857.22	83.57
2	固定收益投资	49,985,000.00	5.40
	其中:债券	49,985,000.00	5.40
	资产支持证券	-	-
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	99,858,395.96	10.78
6	其他资产	2,407,225.84	0.26
7	合计	926,460,479.02	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	9,126,000.00	0.99
B	采矿业	-	-
C	制造业	640,850,812.10	69.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,156,500.00	1.11
E	建筑业	19,321,272.00	2.11
F	批发和零售业	22,609,619.68	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	62,652,863.36	6.83
K	房地产业	9,492,790.08	1.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	774,209,857.22	84.36

5.3 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	000895	双汇发展	1,488,094	69,121,966.30	7.53
2	300080	新大新材	8,056,921	63,246,829.85	6.89
3	600519	贵州茅台	443,337	60,267,231.78	6.57
4	600089	特变电工	3,619,362	43,685,699.34	4.76
5	600537	亿晶光电	2,959,510	40,249,336.00	4.39
6	002309	中利科技	2,257,347	34,876,011.15	3.80
7	600401	海润光伏	4,936,731	31,644,445.71	3.45
8	600600	青岛啤酒	710,487	30,444,367.95	3.32
9	000100	TCL集团	12,361,437	28,184,076.36	3.07
10	600030	中信证券	2,278,464	28,002,322.56	3.05

5.4 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	49,985,000.00	5.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	49,985,000.00	5.45

5.5 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	120019	12附息国债19	500,000	49,985,000.00	5.45

5.6 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。

5.7 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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	502,541.69
2	应收证券清算款	439,250.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,420,446.34
5	应收申购款	44,987.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,407,225.84

5.10.4 报告期末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。

5.10.5 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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	兴全合润分级股票	合润A	合润B
报告期期初基金份额总额	996,559,931.51	24,443,670.00	36,665,506.00
报告期期间基金总申购份额	9,446,098.33	0.00	0.00
减:报告期期间基金总赎回份额	259,619,808.52	0.00	0.00
报告期期间基金拆分变动份额	8,202,320.00	-3,280,928.00	-4,921,392.00
报告期期末基金份额总额	754,588,541.32	21,162,742.00	31,744,114.00

注:1.本期申购含转换转入份额,配对转换转入份额;本期赎回含转换转出份额,配对转换转出份额。其中,合润A、合润B的本期申购(因配对转换入份额)之和等于兴全合润分级股票配对转换出份额;合润A、合润B的本期赎回(因配对转换出份额)之和等于兴全合润分级股票配对转换入份额。

2.兴全合润分级股票型证券投资基金于2013年4月22日进行了定期份额折算、分折,其份额净值调整为1.0000元。定期份额折算、分折方案详见2013年3月7日登载的《兴业全球基金管理有限公司关于兴全合润分级股票型证券投资基金办理定期份额折算、分折业务的提示性公告》。

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§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

1.中国证监会核准基金募集的文件

2、《兴全合润分级股票型证券投资基金基金合同》

3、《兴全合润分级股票型证券投资基金托管协议》

4、《兴全合润分级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.基金托管人业务资格批件和营业执照

7.中国证监会规定的其他文件

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(http://www.xyfunds.com.cn)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
2013年10月25日

兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

2013 第三季度 报告

2013年9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:2013年10月25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2013年10月24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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全沪深300指数(LOF)
基金主代码	163407
交易代码	163407
前端交易代码	163407
后端交易代码	163408
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2010年11月2日
报告期末基金份额总额	1,709,730,471.97份
投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深300指数,并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。本基金力争日均跟踪误差不超过0.5%,年跟踪误差不超过7.75%,日均下方跟踪误差不超过0.3%,年下方跟踪误差不超过4.75%。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深300指数,并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×95%+同业存款利率×5%
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。本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,是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(2013年7月1日 - 2013年9月30日)
1.本期已实现收益	-21,548,656.61
2.本期利润	128,996,504.16
3.加权平均基金份额本期利润	0.0795
4.期末基金资产净值	1,410,000,591.42
5.期末基金份额净值	0.8247

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。

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	11.25%	1.38%	9.02%	1.36%	2.23%	0.02%

3.2.2 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