

兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF)

2015 第一季度 报告

2015年3月31日

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2015年4月22日

1.1 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。

基金管理人兴全基金管理有限公司对本基金合同规定,于2015年4月21日复核了本报告中财务资料、净值表现和投资组合报告等内容,保证其中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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,基金资产净值不受最低保证,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2015年1月1日起至3月31日止。

1.2 基金产品概况

基金简称	兴全趋势投资混合(LOF)
场内简称	兴全趋势
基金代码	163602
场内基金代码	163602
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	上市开放式基金(LOF)
基金合同生效日	2005年11月22日
报告期末基金份额总额	2,873,176,663.90份

本基金为主动管理型股票基金,中长期可预期的确定性收益,通过投资组合的主动管理,力争实现基金资产的长期增值,并实现基金资产的保值增值。

本基金投资于国内证券市场,基金资产投资于股票资产的比例不低于基金资产的60%,投资于非公开发行股票资产的比例不超过基金资产的20%。

本基金为主动管理型股票基金,中长期可预期的确定性收益,通过投资组合的主动管理,力争实现基金资产的长期增值,并实现基金资产的保值增值。

3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2015年1月1日至2015年3月31日)	
1.本期基金份额净值增长率	1.561,006,103.68		
2.本期利润	2,310,689,569.69		
3.加权平均基金份额本期利润	0.2791		
4.期末基金份额净值	1.042,895,957.61		
5.期末基金资产净值	1,462,610,920.18		

注:1.净值表现期间为截至本报告期末最近一个完整会计年度,本基金建仓期为2005年11月22日至2015年5月12日,建仓期结束时本基金各项资产的投资比例符合基金合同规定的比例和投资组合比例限制。

3.2 基金业绩比较基准

名称	净值增长率	业绩比较基准增长率	①-②	③-④
过去三个月	24.79%	11.2%	13.59%	0.89%
过去一年	17.21%	17.21%	0.00%	0.25%

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	4,810,642,480.24	43.56
C	采矿业	115,288,850.00	1.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,229,018.86	0.83
E	建筑业	1,140,394,297.73	10.33
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息传输、软件和信息技术服务业	648,556,530.63	5.87
H	金融业	1,070,197,155.35	9.60
I	房地产业	147,482,300.00	1.34
J	租赁和商务服务业	14,611,592.88	0.13
K	科学研究和技术服务业	-	-
L	卫生和社会工作	-	-
M	教育	-	-
N	文化、体育和娱乐业	181,498,511.10	1.65
O	综合	6,346,609,839.20	57.84

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	601318	中国平安	13,678,389	1,070,197,155.35	9.60
2	000079	中航地产	60,989,337	703,207,286.21	6.27
3	600079	中航地产	1,055,898	504,041,281.24	4.54
4	600998	华谊兄弟	25,511,082	415,720,643.96	3.76
5	000961	华谊兄弟	1,124,118	379,609,440.10	3.41
6	300003	乐普医疗	10,480,000	375,288,000.00	3.35
7	002466	天齐锂业	6,509,979	369,982,106.57	3.30
8	300077	伟明纸业	3,626,424	324,166,041.36	2.94
9	002594	比亚迪	5,999,925	314,296,237.30	2.81
10	601100	华能国际	21,053,643	312,922,024.21	2.81

5.4 报告期末按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	国债逆回购	499,960,000.00	4.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	49,268,979.90	0.45
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	549,228,979.90	4.97

5.5 报告期末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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	091411	14债附息1	3,000,000	299,760,000.00	2.71
2	091423	14附息国债23	2,000,000	200,200,000.00	1.81
3	121009	12国债09	49,268,979.90	49,268,979.90	0.45

5.6 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	有价证券	7,719,299.75	0.07
2	银行存款	589,264,719.98	5.34
3	买入返售金融资产	-	-
4	应收利息	13,762,728.90	0.12
5	应收申购款	11,527,254.23	0.10
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	622,381,496.53	5.63

5.7 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	有价证券	372,288,000.00	3.40	非公开发行

5.8 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	-	-	-

5.9 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	贵金属	-	-	-

5.10 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权证	-	-	-

5.11 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.12 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.13 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.14 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.15 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.16 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.17 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.18 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.19 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.20 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.21 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.22 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.23 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.24 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.25 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.26 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.27 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.28 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.29 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.30 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.31 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.32 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.33 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.34 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.35 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.36 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.37 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.38 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.39 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.40 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.41 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.42 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.43 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.44 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.45 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.46 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.47 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.48 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.49 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.50 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.51 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.52 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.53 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.54 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.55 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.56 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.57 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.58 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	资产支持证券	-	-	-

5.59 报告期末公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1				