兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

2015 第三季度 报告

2015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：2015年10月24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2015年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资混合（LOF）
场内简称	兴全绿色
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	497,534,025.10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	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注：自2015年8月7日起，本基金名称由“兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）”变更为“兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）”。

§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（2015年7月1日 — 2015年9月30日）
1.本期已实现收益	−79,692,301.34
2.本期利润	−389,232,002.12
3.加权平均基金份额本期利润	−0.7302
4.期末基金资产净值	962,277,874.97
5.期末基金份额净值	1.934

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。

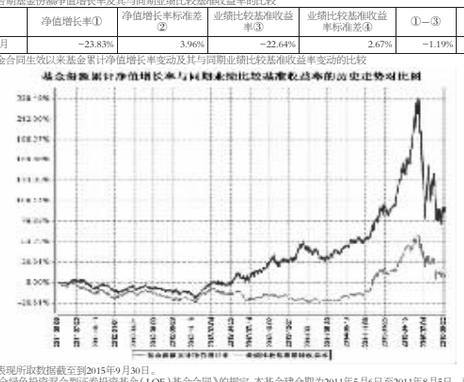
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	−23.83%	3.96%	−22.64%	2.67%	−1.19%	1.29%

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2015年9月30日。

2、按照《兴全绿色投资混合型证券投资基金（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。

3.3 其他指标

无。

§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		
杨岳斌	本基金基金经理	2014年12月8日	−	9年	工商管理硕士，历任招商银行总行营业部、公司银行部，兴业全球基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

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（基金成立时拥担任基金经理）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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（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。管理人于2015年8月3日收到上海证监局发出的《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求对人员行为和异常交易加强日常管理。管理人已积极整改。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，未违法违规、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

经历过前期非常态的大幅调整之后，市场在上证2800点附近基本企稳，并且出现了一定程度的回升。我们分析后认为原因主要有几项：1、美国经济数据偏弱，美联储决定短期不加息，导致美元略为走弱，从而为人民币走强提供支持，市场对于人民币大幅贬值以及系统性金融风险的担忧有所缓解；2、由于国内通胀数据走弱，资金面维持宽松局面，高息资产越来越稀缺，大多数债券资产的收益率普遍下行，这有助于提振股市的估值水平；3、经过前期的调整，估值泡沫在一定程度上被打掉，场外资金清理出基本结束。相当一部分成长股得到市场资金热烈的追捧。

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−23.83%，同期业绩比较基准收益率为−22.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，作为机构投资者应该尽可能避免出现在股市最低时分位最低的情况。毕竟市场已经经历了较大幅度的调整。择时这个工具如果频繁使用，较大概率会出错，对基金净值造成负资献。因此绿色基金保持了一定的仓位。对后市我们认为，在偏弱的宏观经济和较稳定的市场环境下，自下而上在长期看好的行业里面选择估值合理的股票是我们最主要的应对策略。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	699,350,217.15	72.44
	其中：股票	699,350,217.15	72.44
2	基金投资	−	−
3	固定收益投资	70,428,779.60	7.30
	其中：债券	70,428,779.60	7.30
	资产支持证券	−	−
4	贵金属投资	−	−
5	金融衍生品投资	−	−
6	买入返售金融资产	−	−
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	−	−
7	银行存款和结算备付金合计	182,392,582.25	18.89
8	其他资产	13,239,130.67	1.37
9	合计	965,410,709.67	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	366,580,881.06	38.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,546,293.46	2.14
E	建筑业	−	−
F	批发和零售业	47,756,769.20	4.96
G	交通运输、仓储和邮政业	15,564,114.72	1.62
H	住宿和餐饮业	−	−
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,528,643.45	3.90
J	金融业	78,073,246.99	8.11
K	房地产业	23,112,167.87	2.40
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	32,998,024.40	3.43
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	77,190,076.00	8.02
S	综合	−	−
	合计	699,350,217.15	72.68

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	300171	东富龙	4,590,000	92,672,100.00	9.63
2	300054	鼎龙股份	5,102,900	73,634,847.00	7.65
3	002551	尚荣医疗	2,542,719	50,218,700.25	5.22
4	601318	中国平安	1,500,000	44,790,000.00	4.65
5	300336	新文化	1,980,620	40,523,485.20	4.21
6	002280	联络互动	1,050,000	37,023,000.00	3.85
7	300291	华录百纳	1,581,304	34,314,296.80	3.57
8	601601	中国太保	1,499,921	33,283,246.99	3.46
9	002033	丽江旅游	2,661,131	32,998,024.40	3.43
10	002527	新时达	1,710,597	29,285,420.64	3.04

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	29,627,000.00	3.08
2	央行票据	−	−
3	金融债券	40,801,779.60	4.24
	其中：政策性金融债	40,801,779.60	4.24
4	企业债券	−	−
5	企业短期融资券	−	−
6	中期票据	−	−
7	可转债	−	−
8	同业存单	−	−
9	其他	−	−
10	合计	70,428,779.60	7.32

5.5 报告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	130205	13国开05	200,000	20,866,000.00	2.17
2	018001	国开1301	197,560	19,935,779.60	2.07
3	020076	15贴债02	200,000	19,598,000.00	2.04
4	019501	15国债01	100,000	10,029,000.00	1.04

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和拟益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,597,061.40
2	应收证券清算款	9,510,809.88
3	应收股利	−
4	应收利息	2,018,782.58
5	应收申购款	112,476.81
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	13,239,130.67

5.11.4 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。

5.11.5 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价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300336	新文化	40,523,485.20	4.21	非公开发行

5.11.6 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	683,883,231.74
报告期期间基金总申购份额	98,387,074.15
减：报告期期间基金总赎回份额	284,736,280.79
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“−”填列）	−
报告期期末基金份额总额	497,534,025.10

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	4,765,967.59
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,765,967.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.95

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2015年7月7日	4,765,967.59	10,000,000.00	−
	合计		4,765,967.59	10,000,000.00	

注：1、“交易日期”为交易确认日或分红权益登记日。

2、申购交易费率为1000元/笔。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

自2015年8月7日起，本基金名称由“兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）”变更为“兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）”。本次基金更名不改变基金投资范围、投资比例等，对基金持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，按照基金合同的约定，不需要召开持有人大会。

§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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》

3、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

4、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（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
2015年10月24日

兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）

2015 第三季度 报告

2015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：2015年10月24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2015年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全轻资产混合（LOF）
场内简称	兴全轻资
基金主代码	163412
交易代码	163412
前端交易代码	163412
后端交易代码	163413
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2012年4月5日
报告期末基金份额总额	595,996,639.47份
投资目标	本基金以挖掘“轻资产公司”为主要投资策略，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，除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	80%×沪深300指数+20%×中证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金产品，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

注：自2015年8月7日起，本基金名称由“兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）”变更为“兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）”。

§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（2015年7月1日 — 2015年9月30日）
1.本期已实现收益	−42,168,078.63
2.本期利润	−181,805,010.09
3.加权平均基金份额本期利润	−0.3395
4.期末基金资产净值	1,215,363,603.15
5.期末基金份额净值	2.039

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	−13.20%	3.23%	−22.64%	2.67%	9.44%	0.56%

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2015年9月30日。

2、按照《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为2012年4月5日至2012年10月4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。

3.3 其他指标

无。

§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	基金管理部投资副总监兼本基金、兴全合润分级股票型证券投资基金基金经理	2014年12月8日	−	7年	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（基金成立时拥担任基金经理）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、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（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。管理人于2015年8月3日收到上海证监局发出的《关于对兴业全球基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，要求对人员行为和异常交易加强日常管理。管理人已积极整改。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，未违法违规、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

本基金在15年3季度，对仓位和持仓进行一定调整，总体保持较低的仓位，整体配置趋向保守，在控制风险的前提下适度参与反弹。具体操作主要包括在3季度前期继续减持已泡沫化的成长股，在季度相当时间内保持了较低的仓位，以规避系统性风险；在3季度中后期，随着资金去杠杆化对市场的边际影响逐渐减弱，市场逐步企稳，本基金较前期适度增加了仓位。持仓结构上，总体增加了包括消费、医药等长期品种的相关配置权重，在市场企稳后，在控制整体仓位和结构风险的前提基础下，阶段性增持了部分前期跌幅较大的互联网、农业等弹性品种，适度增加组合中弹性品种的权重，以期望组合能更好的分享市场反弹的收益。

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−13.20%，同期业绩比较基准收益率为−22.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然对宏观经济难言乐观，但正如本基金二季报所述，我们认为A股市场过去一段时间的暴跌行情并不会是常态，在市场信心降至新低的情况下，反而需要开始保持谨慎乐观的心态，从更长的周期看，部分好公司有望在此轮市场暴跌中赢来较好的价值投资买点。因此四季度，本基金将继续积极寻求机会，重点市场那些从长期来看凸显投资价值的个股，在控制风险为前提，努力把握阶段性机会，持续为投资者创造长期价值。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	902,316,002.44	71.87
	其中：股票	902,316,002.44	71.87
2	基金投资	−	−
3	固定收益投资	43,812,094.70	3.49
	其中：债券	43,812,094.70	3.49
	资产支持证券	−	−
4	贵金属投资	−	−
5	金融衍生品投资	−	−
6	买入返售金融资产	−	−
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	−	−
7	银行存款和结算备付金合计	221,856,232.48	17.67
8	其他资产	87,556,930.85	6.97
9	合计	1,255,541,260.47	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	144,538,363.75	11.89
B	采矿业	−	−
C	制造业	485,187,525.45	39.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	−	−
E	建筑业	−	−
F	批发和零售业	58,167,734.60	4.79
G	交通运输、仓储和邮政业	30,636,060.84	2.52
H	住宿和餐饮业	−	−
I	信息传输、软件和信息技术服务业	131,929,865.71	10.86
J	金融业	−	−
K	房地产业	−	−
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	51,856,452.09	4.27
S	综合	−	−
	合计	902,316,002.44	74.24

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	300054	鼎龙股份	4,964,763	71,641,530.09	5.89
2	300063	天龙集团	1,442,733	51,217,021.50	4.21
3	300336	新文化	1,617,165	40,493,811.60	3.33
4	300271	华宇软件	1,101,246	38,818,921.50	3.19
5	300113	顺网科技	813,945	35,797,301.10	2.95
6	002280	联络互动	1,014,076	35,756,319.76	2.94
7	300210	森远股份	2,497,609	35,715,808.70	2.94
8	002458	益生股份	1,839,460	32,742,388.00	2.69
9	000513	丽珠集团	811,905	32,468,080.95	2.67
10	002234	民和股份	3,243,897	31,984,824.42	2.63

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	−	−
2	央行票据	−	−
3	金融债券	43,812,094.70	3.60
	其中：政策性金融债	43,812,094.70	3.60
4	企业债券	−	−
5	企业短期融资券	−	−
6	中期票据	−	−
7	可转债	−	−
8	同业存单	−	−
9	其他	−	−
10	合计	43,812,094.70	3.60

5.5 报告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	018001	国开1301	434,170	43,812,094.70	3.60

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按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

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和拟益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和拟益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,335,138.66
2	应收证券清算款	−
3	应收股利	−
4	应收利息	1,915,702.92
5	应收申购款	84,306,089.27
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	87,556,930.85

5.11.4 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。

5.11.5 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价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000513	丽珠集团	32,468,080.95	2.67	筹划重大事项

5.11.6 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	497,456,927.21
报告期期间基金总申购份额	331,297,349.26
减：报告期期间基金总赎回份额	232,757,637.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“−”填列）	−
报告期期末基金份额总额	595,996,639.47

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基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	4,772,792.36
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,772,792.36
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.80

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	申购	2015年7月7日	4,772,792.36	10,000,000.00	−
	合计		4,772,792.36	10,000,000.00	

注：1、“交易日期”为交易确认日或分红权益登记日。

2、申购交易费率为1000元/笔。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

自2015年8月7日起，本基金名称由“兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）”变更为“兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）”。本次基金更名不改变基金投资范围、投资比例等，对基金持有人利益无实质性不利影响，且不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化，按照基金合同的约定，不需要召开持有人大会。

§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、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》

3、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

4、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）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
2015年10月24日

兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

2015 第三季度 报告

2015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：兴业银行股份有限公司
报告送出日期：2015年10月24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2015年10月22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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全趋势投资混合（LOF）
场内简称	兴全趋势
基金主代码	163402
交易代码	163402
前端交易代码	163402
后端交易代码	163403
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005年11月3日
报告期末基金份额总额	4,337,646,622.59份
投资目标	本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益，增