# 兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31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：2016年1月22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2016年1月21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10月1日起至12月31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 | 985,309,567.85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 |

§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10月1日 － 2015年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 148,686,195.36 |
| 2.本期利润 | 498,165,251.30 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.6568 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,726,218,071.32 |
| 5.期末基金份额净值 | 2.767 |

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。

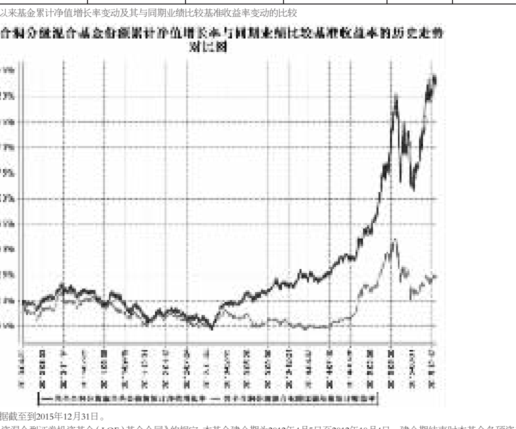
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 35.70% | 2.03% | 13.77% | 1.34% | 21.93% | 0.69% |

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12月31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、兴全合润分级混合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。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

本基金在15年4季度，整体仓位较前期有所提高，持仓结构有所调整，具体操作主要包括在4季度前期继续增持前期超跌成长股，配置品种以VR等行业发展趋势方向相对明确的新兴子行业以及农业等阶段性处于景气周期的弹性个股为主，整体持仓结构偏积极，以期组合能更好的分享市场反弹收益；在4季度中后期，对成长股及传统蓝筹的持仓权重进行优化，操作主要基于市场经历了较长时间和较大幅度的反弹，部分公司再次进入泡沫区间，而低估值蓝筹品种本轮反弹较少，从价值相对角度具备较大吸引力，阶段性有望迎来较前期更好的相对收益机会，因此本着控制风险的原则，本基金在4季度中后期适度增加了低估值蓝筹类品种的仓位权重，以期降低后期波动。整体看，4季度操作相对业绩比较基准获得了较为明显的超额收益。

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35.7%，同期业绩比较基准收益率为13.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年，实体经济改善预期难言乐观；资金面进一步宽松空间十分有限，需警惕流动性拐点；注册制实施，股票供给压力大于2015年；目前市场总体估值不低。在此大背景下，2016年预期收益率应较今年有所降低，整体投资策略趋于谨慎。仍有如下积极因素值得关注，将成为本基金配置的主要指导基础：

（1）部分传统周期性行业，政策推动下行业供给收缩，有望带来企业盈利的边际改善。

（2）代表经济转型的方向性行业，如新消费、高端制造、农业现代化、信息产业等将有望获得政策与资本的持续推动，加速发展。

（3）前沿新兴科技不断涌现，相关领域必将成为资本关注的焦点。

（4）缺乏活力的传统旧经济领域，转型重组事件活跃，或蕴藏较好的挖潜机会。

本基金2016年一季度将积极调整持仓结构，更加均衡配置，密切关注上述可能存在的积极因素变化方向，在控制风险的原则下，力争降低波动，积极为投资者创造长期投资回报。

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 | 2,327,341,480.56 | 83.98 |
| | 其中：股票 | 2,327,341,480.56 | 83.98 |
| 2 | 基金投资 | － | － |
| 3 | 固定收益投资 | 150,716,641.70 | 5.44 |
| | 其中：债券 | 150,716,641.70 | 5.44 |
| | 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 | 255,039,021.02 | 9.20 |
| 8 | 其他资产 | 38,104,227.74 | 1.38 |
| 9 | 合计 | 2,771,201,371.02 | 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 | 262,428,204.25 | 9.63 |
| B | 采矿业 | 77,718,966.00 | 2.85 |
| C | 制造业 | 1,099,969,275.48 | 40.35 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 30,742,800.00 | 1.13 |
| E | 建筑业 | － | － |
| F | 批发和零售业 | 9,571,215.44 | 0.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,522,698.88 | 0.24 |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 398,382,511.53 | 14.61 |
| J | 金融业 | 190,815,054.64 | 7.00 |
| K | 房地产业 | 110,973,247.67 | 4.07 |
| L | 租赁和商务服务业 | － | － |
| M | 科学研究和技术服务业 | 84,222,790.97 | 3.09 |
| 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 | 55,994,715.70 | 2.05 |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 2,327,341,480.56 | 85.37 |

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 | 5,603,234 | 141,929,917.22 | 5.21 |
| 2 | 300113 | 顺网科技 | 1,283,074 | 130,065,211.38 | 4.77 |
| 3 | 002458 | 益生股份 | 3,127,682 | 118,226,379.60 | 4.34 |
| 4 | 300271 | 华宇软件 | 2,367,911 | 112,428,414.28 | 4.12 |
| 5 | 002488 | 金固股份 | 2,956,570 | 85,740,530.00 | 3.15 |
| 6 | 300012 | 华测检测 | 3,425,083 | 84,222,790.97 | 3.09 |
| 7 | 002234 | 民和股份 | 4,470,505 | 80,379,679.90 | 2.95 |
| 8 | 601628 | 中国人寿 | 2,788,580 | 78,944,699.80 | 2.90 |
| 9 | 002554 | 惠博普 | 5,978,382 | 77,718,966.00 | 2.85 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 1,458,481 | 75,884,766.43 | 2.78 |

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 | 56,310,300.00 | 2.07 |
| 2 | 央行票据 | － | － |
| 3 | 金融债券 | 94,406,341.70 | 3.46 |
| | 其中：政策性金融债 | 43,421,341.70 | 1.59 |
| 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 | 150,716,641.70 | 5.53 |

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 | 020081 | 15贴债07 | 570,000 | 56,310,300.00 | 2.07 |
| 2 | 1208001 | 12民生01 | 500,000 | 50,985,000.00 | 1.87 |
| 3 | 018001 | 国开1301 | 434,170 | 43,421,341.70 | 1.59 |

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损益明细

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损益明细

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 | 1,457,113.62 |
| 2 | 应收证券清算款 | － |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 4,692,716.54 |
| 5 | 应收申购款 | 31,954,397.58 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 38,104,227.74 |

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 | 300054 | 鼎龙股份 | 141,929,917.22 | 5.21 | 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 | 595,996,639.47 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 666,595,401.51 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 277,282,473.13 |
| 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 | 985,309,567.85 |

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 | 4,772,792.36 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 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（%） | 0.48 |

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

本基金管理人本报告期末运用固有资金对本基金进行交易。

§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**
**2016年1月22日**

# 兴全合润分级混合型证券投资基金

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31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：2016年1月22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2016年1月21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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金简称 | 兴全合润分级混合 | | |
| 场内简称 | 兴全合润 | | |
| 基金主代码 | 163406 | | |
| 交易代码 | 163406 | | |
| 前端交易代码 | － | | |
| 后端交易代码 | － | | |
| 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 | 1,141,864,134.49份 | | |
| 投资目标 | 本基金以定性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 | 本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均为中高，属于中高风险、中高收益的基金品种。 | | |
| 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 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 兴全合润分级混合 | 合润A | 合润B |
| 下属分级基金的场内简称 | 兴全合润 | 合润A | 合润B |
| 下属分级基金的交易代码 | 163406 | 150016 | 150017 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,123,414,848.49份 | 7,379,714.00份 | 11,069,572.00份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 从基金份额整体运作来看，本基金资产整体的预期收益和预期风险均为中高，属于中高风险、中高收益的基金品种。 | 根据本基金合润A份额与合润B份额的关系约定，合润A份额将表现出低风险、预期收益较低的风险收益特征。 | 根据本基金合润A份额与合润B份额的关系约定，合润B份额在合润基金份额净值在一定区间内具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般混合型份额更高的风险特征。 |

§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10月1日 － 2015年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 231,647,801.61 |
| 2.本期利润 | 760,176,073.83 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.7388 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,477,403,108.95 |
| 5.期末基金份额净值 | 3.0454 |

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 | 35.21% | 2.02% | 13.77% | 1.34% | 21.44% | 0.68% |

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12月31日。

2、按照《兴全合润分级混合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。

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、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理 | 2013年1月29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、《兴全合润分级混合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

本基金在15年4季度，整体仓位较前期有所提高，持仓结构有所调整，具体操作主要包括在4季度前期继续增持前期超跌成长股，配置品种以VR等行业发展趋势方向相对明确的新兴子行业以及农业等阶段性处于景气周期的弹性个股为主，整体持仓结构偏积极，以期组合能更好的分享市场反弹收益；在4季度中后期，对成长股及传统蓝筹的持仓权重进行优化，操作主要基于市场经历了较长时间和较大幅度的反弹，部分公司再次进入泡沫区间，而低估值蓝筹品种本轮反弹较少，从价值相对角度具备较大吸引力，阶段性有望迎来较前期更好的相对收益机会，因此本着控制风险的原则，本基金在4季度中后期适度增加了低估值蓝筹类品种的仓位权重，以期降低后期波动。整体看，4季度操作相对业绩比较基准获得了较为明显的超额收益。

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35.21%，同期业绩比较基准收益率为13.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年，实体经济改善预期难言乐观；资金面进一步宽松空间十分有限，需警惕流动性拐点；注册制实施，股票供给压力大于2015年；目前市场总体估值不低。在此大背景下，2016年预期收益率应较今年有所降低，整体投资策略趋于谨慎。仍有如下积极因素值得关注，将成为本基金配置的主要指导基础：

（1）部分传统周期性行业，政策推动下行业供给收缩，有望带来企业盈利的边际改善。

（2）代表经济转型的方向性行业，如新消费、高端制造、农业现代化、信息产业等将有望获得政策与资本的持续推动，加速发展。

（3）前沿新兴科技不断涌现，相关领域必将成为资本关注的焦点。

（4）缺乏活力的传统旧经济领域，转型重组事件活跃，或蕴藏较好的挖潜机会。

本基金2016年一季度将积极调整持仓结构，更加均衡配置，密切关注上述可能存在的积极因素变化方向，在控制风险的原则下，力争降低波动，积极为投资者创造长期投资回报。

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 | 3,002,672,062.37 | 85.25 |
| | 其中：股票 | 3,002,672,062.37 | 85.25 |
| 2 | 固定收益投资 | 231,100,206.30 | 6.56 |
| | 其中：债券 | 231,100,206.30 | 6.56 |
| | 资产支持证券 | － | － |
| 3 | 贵金属投资 | － | － |
| 4 | 金融衍生品投资 | － | － |
| 5 | 买入返售金融资产 | － | － |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | － | － |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 266,519,430.43 | 7.57 |
| 7 | 其他资产 | 21,918,908.75 | 0.62 |
| 8 | 合计 | 3,522,210,607.85 | 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 | 324,049,014.52 | 9.32 |
| B | 采矿业 | 86,231,730.00 | 2.48 |
| C | 制造业 | 1,473,400,574.68 | 42.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 51,292,800.00 | 1.48 |
| E | 建筑业 | － | － |
| F | 批发和零售业 | 14,288,096.44 | 0.41 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,538,752.00 | 0.19 |
| H | 住宿和餐饮业 | － | － |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 512,965,385.77 | 14.75 |
| J | 金融业 | 225,873,175.26 | 6.50 |
| K | 房地产业 | 148,981,592.78 | 4.28 |
| L | 租赁和商务服务业 | － | － |
| M | 科学研究和技术服务业 | 107,962,591.72 | 3.10 |
| 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 | 51,088,349.20 | 1.47 |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 3,002,672,062.37 | 86.35 |

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 | 8,942,902 | 226,523,707.66 | 6.51 |
| 2 | 300113 | 顺网科技 | 1,839,786 | 186,499,106.82 | 5.36 |
| 3 | 002458 | 益生股份 | 3,989,528 | 150,804,158.40 | 4.34 |
| 4 | 300271 | 华宇软件 | 3,154,283 | 149,765,356.84 | 4.31 |
| 5 | 300063 | 天龙集团 | 2,829,342 | 122,595,388.86 | 3.53 |
| 6 | 300012 | 华测检测 | 4,390,508 | 107,962,591.72 | 3.10 |
| 7 | 002322 | 理工监测 | 3,999,591 | 101,069,664.57 | 2.91 |
| 8 | 002234 | 民和股份 | 5,539,147 | 99,593,863.06 | 2.86 |
| 9 | 002488 | 金固股份 | 3,227,666 | 93,602,314.00 | 2.69 |
| 10 | 000513 | 丽珠集团 | 1,594,797 | 91,589,191.71 | 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 | 231,100,206.30 | 6.65 |
| | 其中：政策性金融债 | 180,115,206.30 | 5.18 |
| 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 | 231,100,206.30 | 6.65 |

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 | 1,736,220 | 173,639,362.20 | 4.99 |
| 2 | 1208001 | 12民生01 | 500,000 | 50,985,000.00 | 1.47 |
| 3 | 018002 | 国开1302 | 59,070 | 6,475,844.10 | 0.19 |

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损益明细

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损益明细

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 | 2,325,259.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | － |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 11,917,712.47 |
| 5 | 应收申购款 | 7,675,936.94 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 21,918,908.75 |

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 | 300054 | 鼎龙股份 | 226,523,707.66 | 6.51 | 重大事项 |
| 2 | 300063 | 天龙集团 | 122,595,388.86 | 3.53 | 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

| 项目 | 兴全合润分级混合 | 合润A | 合润B |
|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 858,827,671.10 | 7,244,858.00 | 10,867,288.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 368,446,481.27 | 482,360.00 | 723,540.00 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 103,859,303.88 | 347,504.00 | 521,256.00 |
| 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 | 1,123,414,848.49 | 7,379,714.00 | 11,069,572.00 |

注：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（即配对转换入份额）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（即配对转换出份额）之和等于兴全合润分级股票配对转换入份额。

§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 | 4,362,375.11 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 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 | 4,362,375.11 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.38 |

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

本基金管理人本报告期末运用固有资金对本基金进行交易。

§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、《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》

3、《兴全合润分级混合型证券投资基金托管协议》

4、《兴全合润分级混合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**
**2016年1月22日**

# 兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

## 2015 第四季度 报告

2015年12月31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：2016年1月22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2016年1月21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10月1日起至12月31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 | 747,582,040.08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 |

§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10月1日 － 2015年12月31日） |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | －76,405,269.01 |
| 2.本期利润 | 317,072,849.42 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.3618 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,268,534,360.79 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.697 |

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。

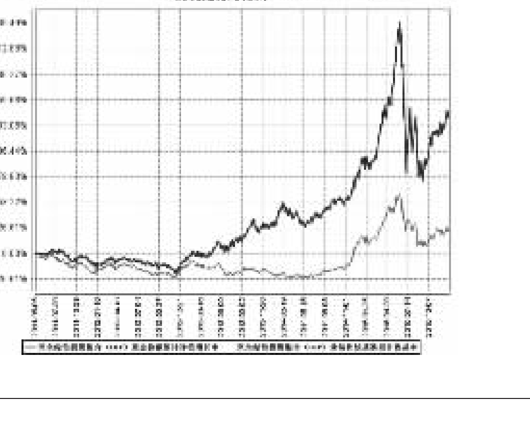
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 | 25.61% | 1.66% | 13.77% | 1.34% | 11.84% | 0.32% |

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12月31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。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

在经历了三季度市场大跌之后，四季度的市场走出了一轮反弹行情，走势上基本是以创业板为主的成长股的反弹行情为主基调。绿色基金在国庆前夕就维持了一定的仓位，避免了底部踏空风险，并且将部分仓位适度切换到了成长股的结构。四季度，绿色基金进行了一次分红。

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25.61%，同期业绩比较基准收益率为13.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2016年的市场，我们虽然预判到了美国的加息，也注意到1月8号有大股东解禁的压力，以及机构较多持有成长股的现状。因此在2015年年底，绿色基金维持不高的仓位，配置一定比例的定增股票和停牌股票，适度回避估值偏高的个股。但开年之后市场调整幅度之大依然超出了市场大部分人的预期。

对于2016年的市场，绿色基金认为在存量博弈的前提下，市场难以复制2015年的行情。绿色基金会坚持自下而上的精选个股的方式进行组合投资。未来我们会更关注估值和成长性结合比较好的个股。

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 | 1,005,163,257.91 | 78.95 |
| | 其中：股票 | 1,005,163,257.91 | 78.95 |
| 2 | 基金投资 | － | － |
| 3 | 固定收益投资 | 110,438,988.00 | 8.67 |
| | 其中：债券 | 110,438,988.00 | 8.67 |
| | 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 | 153,214,858.49 | 12.03 |
| 8 | 其他资产 | 4,312,491.86 | 0.34 |
| 9 | 合计 | 1,273,129,596.26 | 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 | 674,366,770.92 | 53.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | － | － |
| E | 建筑业 | 37,139,758.74 | 2.93 |
| F | 批发和零售业 | 31,803,952.32 | 2.51 |
| 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 | 70,356.00 | 0.01 |
| J | 金融业 | － | － |
| K | 房地产业 | 60,537,990.80 | 4.77 |
| L | 租赁和商务服务业 | － | － |
| M | 科学研究和技术服务业 | 109,392.21 | 0.01 |
| 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 | 201,135,036.92 | 15.86 |
| S | 综合 | － | － |
| | 合计 | 1,005,163,257.91 | 79.24 |

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 | 5,102,900 | 129,256,457.00 | 10.19 |
| 2 | 300171 | 东富龙 | 4,059,900 | 121,715,802.00 | 9.59 |
| 3 | 300336 | 新文化 | 1,980,620 | 77,085,730.40 | 6.08 |
| 4 | 600114 | 东睦股份 | 4,455,721 | 72,004,451.36 | 5.68 |
| 5 | 000802 | 北京文化 | 1,999,849 | 67,754,884.12 | 5.34 |
| 6 | 300291 | 华录百纳 | 1,581,304 | 56,294,422.40 | 4.44 |
| 7 | 000860 | 顺鑫农业 | 2,514,095 | 53,550,223.50 | 4.22 |
| 8 | 600079 | 人福医药 | 2,154,899 | 47,968,051.74 | 3.78 |
| 9 | 300227 | 光韵达 | 1,299,975 | 47,449,087.50 | 3.74 |
| 10 | 300145 | 南方泵业 | 799,980 | 38,095,047.60 | 3.00 |

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 | 88,836,988.00 | 7.00 |
| 2 | 央行票据 | － | － |
| 3 | 金融债券 | 21,602,000.00 | 1.70 |
| | 其中：政策性金融债 | 21,602,000.00 | 1.70 |
| 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 | 110,438,988.00 | 8.71 |

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 | 020091 | 15贴债17 | 600,000 | 59,316,000.00 | 4.68 |
| 2 | 130205 | 13国开05 | 200,000 | 21,602,000.00 | 1.70 |
| 3 | 020076 | 15贴债02 | 200,000 | 19,558,000.00 | 1.54 |
| 4 | 019501 | 15国债01 | 99,600 | 9,962,988.00 | 0.79 |

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损益明细

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损益明细

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 | 1,048,108.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | － |
| 3 | 应收股利 | － |
| 4 | 应收利息 | 1,799,456.53 |
| 5 | 应收申购款 | 1,464,927.30 |
| 6 | 其他应收款 | － |
| 7 | 待摊费用 | － |
| 8 | 其他 | － |
| 9 | 合计 | 4,312,491.86 |

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 | 77,085,730.40 | 6.08 | 非公开发行 |
| 2 | 300054 | 鼎龙股份 | 129,256,457.00 | 10.19 | 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 | 497,534,025.10 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,886,359,928.38 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 2,636,311,913.40 |
| 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 | 747,582,040.08 |

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 | 4,765,967.59 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 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（%） | 0.64 |

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

本基金管理人本报告期末运用固有资金对本基金进行交易。

§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**
**2016年1月22日**