

兴全轻资产投资股票型证券投资基金 (LOF)

2012 年半年度报告

2012 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

送出日期：2012 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2012 年 8 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 4 月 5 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11

§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
7.6 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	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	39
7.8 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	39
7.9 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末上市基金前十名持有人	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	43
§11 影响投资者决策的其他重要信息	45
§12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全轻资产股票（LOF）
基金主代码	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
基金管理人	兴全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
报告期末基金份额总额	744,185,826.19 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012-05-31

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张燕
	联系电话	021-58368998	0755-83199084
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-58368858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200122	518040
法定代表人	兰荣	傅育宁

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	中国北京市西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012 年 4 月 5 日 - 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-7,974,070.53
本期利润	-5,754,208.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0062
本期加权平均净值利润率	-0.62%
本期基金份额净值增长率	-0.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-7,040,324.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0095
期末基金资产净值	739,032,167.19
期末基金份额净值	0.993
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-0.70%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关

法规。

2、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。

3、上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：开放式基金的申购赎回费、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、本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效，截至 2012 年 6 月 30 日，本基金成立不满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.50%	0.48%	-5.14%	0.86%	4.64%	-0.38%
自基金合同生效起至今	-0.70%	0.29%	0.71%	0.89%	-1.41%	-0.60%

注：本基金业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：沪深 300 指数和中证国债指数具有较强的代表性。沪深 300 指数选择中国 A 股市场市值规模最大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股，充分反映了 A 股市场的行业代表性，描述了沪深 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

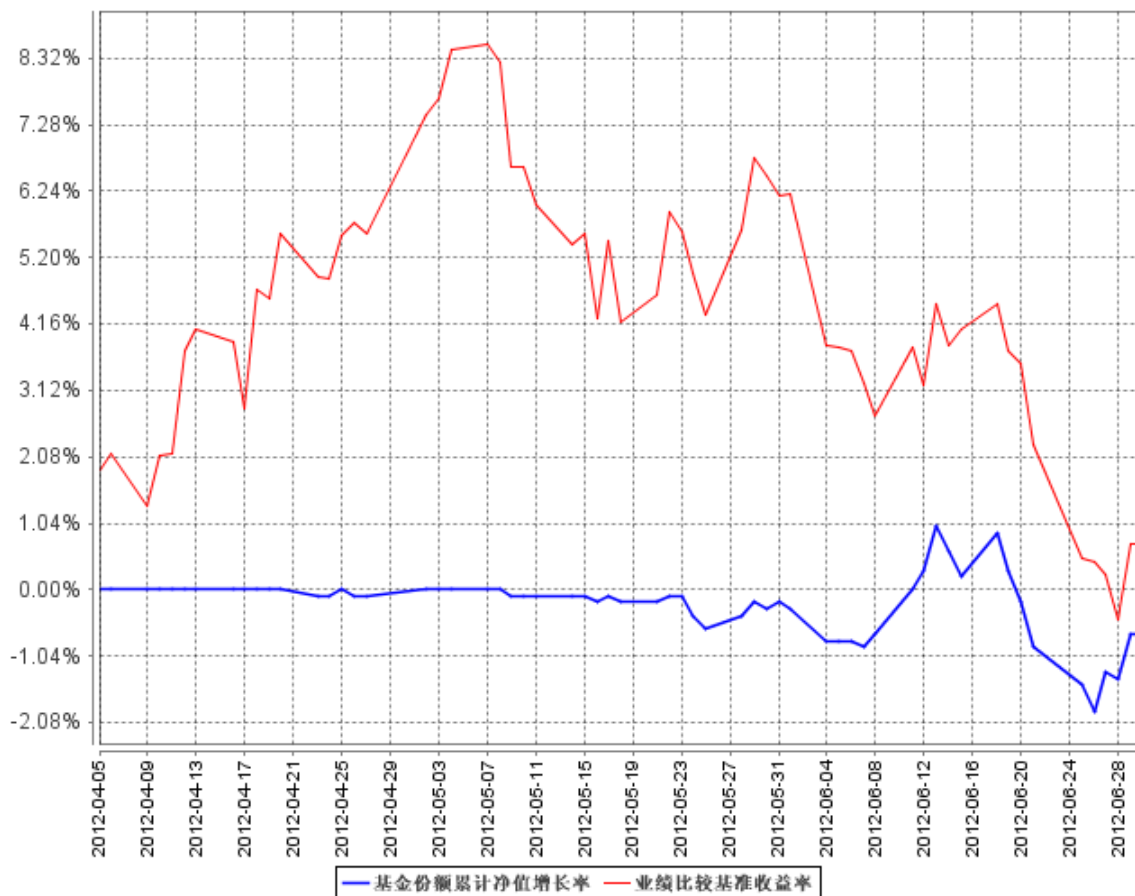
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中证国债指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2012 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金应自 2012 年 4 月 5 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，目前本基金还在建仓期内。

3、本基金成立于 2012 年 4 月 5 日，截止 2012 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴全全球基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）是经证监基金字[2003] 100 号文批准于 2003 年 9 月 30 日成立。2008 年 1 月 2 日，中国证监会批准（证监许可[2008]6 号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的 51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的 49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴全全球人寿基金管理有限公司”，公司注册资本由 9800 万元变更为 1.2 亿元人民币。2008 年 7 月 7 日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888 号文），公司名称由“兴全全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴全全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币 1.2 亿元变更为人民币 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。

截止 2012 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十二只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2012 年 4 月 5 日	-	11 年	1971 年生，工商管理硕士，历任北京宏基兴业技术有限公司副总经理，上海奥盛投资有限公司总经理，兴全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：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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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、考察是否存在不公平的因素。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

轻资产成立之初我们判断今后两三个月内市场并不会有大的系统性向上的行情，而作为一只新基金也应以稳健起步为原则，谨慎地逐步建仓。我们还希望建仓期内能够先尽可能控制净值的向下波动的幅度，尤其是在两个月的封闭期内。

我们基本上采取了控制仓位，集中配置，追求持仓的有效性的操作原则。我们希望轻资产基金的运作能多一些绝对收益的意识和做法，尽量为持有人获取较低风险暴露下的实在的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-0.70%，同期业绩比较基准收益率 0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增速放缓已成定局，何时见底尚难下定论，与此同时 CPI 逐渐回落，市场流动性渐转宽松，经济困难和流动性放松交织。在证券市场上，大盘逐次下行寻求支撑和结构性行情此起彼伏正是上述状况在市场中映射。

政策上国家仍然以追求增速、结构、通胀三者的平衡为导向。我们不宜对政策刺激抱过高期望，对困难的长期性要有足够的思想准备。证券市场本身也面临着发展中的困难，面临着供求失衡和再平衡的难题。因此，返璞归真去寻找真正优秀的公司才是真正有效的策略——我们要致力寻找能够穿越周期、成长确定、估值合理的公司。

我们认为，中国走向富裕社会至少是未来五到十年投资主线，我们重视由此生发出来的各种机会。我们重点配置安防、园林装饰、消费电子和食品饮料正是这种思维的产物。我们也关注政策的重点支持可能带来的一些板块的投资机会。当然，更为理想的是上述两种线索的交集，比如环保。在经济不景和结构转型的大背景下，成长确定而又估值合理的公司确实显得更有吸引力。

我们依然坚持认为“A 股的投资价值首推成长”“成长穿越一切周期”。我们会坚持成长风格，集中配置少折腾，再多一点绝对收益的意识。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经历，具备估值业务所需的专业胜任能力。
上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	240,043,097.81
结算备付金		3,696,751.72
存出保证金		500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	331,665,503.84
其中：股票投资		292,881,503.84
基金投资		-
债券投资		38,784,000.00
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	200,000,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	932,231.74
应收股利		-
应收申购款		116,362.42
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		776,953,947.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		31,589,573.46
应付赎回款		4,002,415.01
应付管理人报酬		974,711.56
应付托管费		162,451.96
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	622,649.19
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	569,979.16
负债合计		37,921,780.34
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	744,185,826.19
未分配利润	6.4.7.10	-5,153,659.00
所有者权益合计		739,032,167.19
负债和所有者权益总计		776,953,947.53

注：1、报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.993 元，基金份额总额 744,185,826.19 份。

2、本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。

6.2 利润表

会计主体：兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入		-760,901.83
1.利息收入		2,872,744.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,024,679.94
债券利息收入		44,838.47
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,803,226.13
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,604,967.80
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-7,604,571.45
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	304,575.25
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	695,028.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,219,862.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	751,458.92
减：二、费用		4,993,306.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,253,644.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	542,274.13

3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,063,245.63
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	134,141.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,754,208.02
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,754,208.02

注：本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效，本期数据按实际存续期计算。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	993,929,233.72	-	993,929,233.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,754,208.02	-5,754,208.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-249,743,407.53	600,549.02	-249,142,858.51
其中：1.基金申购款	945,176.94	-5,523.74	939,653.20
2.基金赎回款	-250,688,584.47	606,072.76	-250,082,511.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	744,185,826.19	-5,153,659.00	739,032,167.19

注：本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效，本期数据按实际存续期计算。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>兰荣</u>	<u>杨东</u>	<u>詹鸿飞</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]2161 号文《关于核准兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》的核准，由兴业全球基金管理有限公司作为发起人于 2012 年 2 月 27 日至 2012 年 3 月 27 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2012）验字第 60467611_B01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 993,401,130.26 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 528,103.46 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 993,929,233.72 元，折合 993,929,233.72 份基金份额。本基金的基金管理人为兴业全球基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为股票型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合轻资产投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为 $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证国债指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

（3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付

的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。本基金的公允价值的计量分为三个层次，第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1) 上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市的股票的估值

A. 送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B. 首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C. 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的首次取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3) 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4) 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

5) 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 60%；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问

题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50%计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	140,043,097.81
定期存款	100,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	100,000,000.00
其他存款	-
合计：	240,043,097.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	290,642,081.33	292,881,503.84	2,239,422.51

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	38,803,560.00	38,784,000.00	-19,560.00
	合计	38,803,560.00	38,784,000.00	-19,560.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		329,445,641.33	331,665,503.84	2,219,862.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	200,000,000.00	-
合计	200,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	32,341.37
应收定期存款利息	62,500.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,663.60
应收债券利息	762,393.44
应收买入返售证券利息	73,333.33
应收申购款利息	-
其他	-
合计	932,231.74

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	619,444.98
银行间市场应付交易费用	3,204.21
合计	622,649.19

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	12,193.76
预提费用	57,785.40
合计	569,979.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 4 月 5 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	993,929,233.72	993,929,233.72
本期申购	945,176.94	945,176.94
本期赎回(以“-”号填列)	-250,688,584.47	-250,688,584.47
本期末	744,185,826.19	744,185,826.19

注：1、申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

2、本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 993,401,130.26 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 528,103.46 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 993,929,233.72 元，折合 993,929,233.72 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-7,974,070.53	2,219,862.51	-5,754,208.02
本期基金份额交易产生的变动数	933,745.79	-333,196.77	600,549.02
其中：基金申购款	-5,447.89	-75.85	-5,523.74

基金赎回款	939,193.68	-333,120.92	606,072.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,040,324.74	1,886,665.74	-5,153,659.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年4月5日至2012年6月30日
活期存款利息收入	947,455.17
定期存款利息收入	62,500.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	14,724.77
其他	-
合计	1,024,679.94

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年4月5日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	298,101,036.17
减：卖出股票成本总额	305,705,607.62
买卖股票差价收入	-7,604,571.45

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年4月5日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,209,217.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,904,000.00
减：应收利息总额	641.75
债券投资收益	304,575.25

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年4月5日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	695,028.40

基金投资产生的股利收益	-
合计	695,028.40

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,219,862.51
——股票投资	2,239,422.51
——债券投资	-19,560.00
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,219,862.51

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	750,104.19
转换费收入	151.18
其他	1,203.55
合计	751,458.92

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,062,995.63
银行间市场交易费用	250.00
合计	1,063,245.63

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	57,785.40
证券开户费	900.00
银行费用	5,456.42
上市费	70,000.00

合计	134,141.82
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司（以下简称“兴业全球基金”）	基金管理人，基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人，基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东，基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年4月5日(基金合同生效日)至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	190,890,623.46	21.35%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年4月5日(基金合同生效日)至2012年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	380,000,000.00	15.90%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年4月5日(基金合同生效日)至2012年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
兴业证券	159,106.74	25.69%	159,106.74	25.69%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年4月5日(基金合同生效日)至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,253,644.61
其中：支付销售机构的客户维护费	774,088.44

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年4月5日(基金合同生效日)至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	542,274.13

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2012 年 4 月 5 日至 2012 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2012 年 4 月 5 日）持有的基金份额	20,025,100.00
期初持有的基金份额	—
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	20,025,100.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.69%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2012 年 4 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	240,043,097.81	1,009,955.17

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002686	亿利达	2012 年 6 月 26 日	2012 年 7 月 3 日	新股流通受限	16.00	16.00	500	8,000.00	8,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	240,043,097.81	-	-	-	-	-	240,043,097.81
结算备付金	3,696,751.72	-	-	-	-	-	3,696,751.72
存出保证金	-	-	-	-	-	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	-	-	38,784,000.00	-	-	292,881,503.84	331,665,503.84
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	-	-	200,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	932,231.74	932,231.74

应收申购款	-	-	-	-	116,362.42	116,362.42
资产总计	443,739,849.53	-38,784,000.00	-	-	294,430,098.00	776,953,947.53
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	31,589,573.46	31,589,573.46
应付赎回款	-	-	-	-	4,002,415.01	4,002,415.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	974,711.56	974,711.56
应付托管费	-	-	-	-	162,451.96	162,451.96
应付交易费用	-	-	-	-	622,649.19	622,649.19
其他负债	-	-	-	-	569,979.16	569,979.16
负债总计	-	-	-	-	37,921,780.34	37,921,780.34
利率敏感度缺口	443,739,849.53	-38,784,000.00	-	-	-256,508,317.66	739,032,167.19

注：1、表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2、本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动	
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2012 年 6 月 30 日）
	利率 -1%	169,366.04
	利率 +1%	-167,899.62

注：1、上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	292,881,503.84	39.63
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	38,784,000.00	5.25
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	331,665,503.84	44.88

注：本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型（CAPM）描述的规律进行变动	
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析	
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2012 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准 -10%	-33,532,402.82
	业绩比较基准 +10%	33,532,402.82

注：1、本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于 2012 年 4 月 5 日生效。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	292,881,503.84	37.70
	其中：股票	292,881,503.84	37.70
2	固定收益投资	38,784,000.00	4.99
	其中：债券	38,784,000.00	4.99
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	200,000,000.00	25.74
	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	243,739,849.53	31.37
6	其他各项资产	1,548,594.16	0.20
7	合计	776,953,947.53	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	184,275,317.89	24.93
C0	食品、饮料	57,927,480.70	7.84
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	16,730,322.42	2.26
C5	电子	59,238,607.80	8.02
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	3,620,000.00	0.49
C8	医药、生物制品	46,758,906.97	6.33
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,741,783.93	1.05
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	15,554,285.92	2.10
H	批发和零售贸易	1,051,383.05	0.14

I	金融、保险业	32,162,739.05	4.35
J	房地产业	38,428,254.11	5.20
K	社会服务业	13,667,739.89	1.85
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	292,881,503.84	39.63

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	959,372	26,094,918.40	3.53
2	002236	大华股份	809,258	24,844,220.60	3.36
3	000848	承德露露	1,342,949	23,568,754.95	3.19
4	601336	新华保险	538,363	18,433,549.12	2.49
5	600702	沱牌舍得	501,175	18,167,593.75	2.46
6	600085	同仁堂	999,969	17,449,459.05	2.36
7	000538	云南白药	258,639	15,332,119.92	2.07
8	600750	江中药业	500,800	13,977,328.00	1.89
9	000563	陕国投 A	999,941	13,729,189.93	1.86
10	002159	三特索道	981,173	13,667,739.89	1.85
11	603001	奥康国际	506,431	13,628,058.21	1.84
12	000669	*ST 领先	409,878	10,652,729.22	1.44
13	000732	泰禾集团	1,584,674	10,221,147.30	1.38
14	002646	青青稞酒	300,000	9,501,000.00	1.29
15	300128	锦富新材	499,968	8,299,468.80	1.12
16	000718	苏宁环球	999,955	8,099,635.50	1.10
17	300146	汤臣倍健	99,600	6,690,132.00	0.91
18	002244	滨江集团	730,670	6,627,176.90	0.90
19	600376	首开股份	438,271	5,802,708.04	0.79
20	300017	网宿科技	300,709	4,901,556.70	0.66
21	600383	金地集团	731,795	4,742,031.60	0.64
22	002431	棕榈园林	152,552	3,934,316.08	0.53
23	002482	广田股份	218,193	3,807,467.85	0.52
24	300228	富瑞特装	150,000	3,612,000.00	0.49
25	300198	纳川股份	177,171	3,102,264.21	0.42
26	000537	广宇发展	408,283	2,935,554.77	0.40

27	600056	中国医药	47,899	1,051,383.05	0.14
28	002686	亿利达	500	8,000.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600085	同仁堂	35,986,187.41	4.87
2	000848	承德露露	24,415,982.53	3.30
3	002415	海康威视	23,281,485.93	3.15
4	002236	大华股份	22,970,914.30	3.11
5	600750	江中药业	22,306,314.77	3.02
6	002482	广田股份	22,234,883.81	3.01
7	603001	奥康国际	20,467,867.69	2.77
8	600016	民生银行	19,710,000.00	2.67
9	002159	三特索道	19,597,944.95	2.65
10	601336	新华保险	18,761,391.52	2.54
11	000538	云南白药	17,289,207.36	2.34
12	600702	沱牌舍得	16,773,205.89	2.27
13	000563	陕国投 A	14,982,559.10	2.03
14	601166	兴业银行	14,050,646.87	1.90
15	600376	首开股份	13,830,613.20	1.87
16	601699	潞安环能	13,576,918.00	1.84
17	002431	棕榈园林	13,334,165.36	1.80
18	300070	碧水源	12,308,099.01	1.67
19	300017	网宿科技	12,214,794.81	1.65
20	000732	泰禾集团	11,313,349.00	1.53

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	002482	广田股份	19,654,422.02	2.66
2	600016	民生银行	18,920,000.00	2.56

3	600085	同仁堂	18,236,641.30	2.47
4	601166	兴业银行	13,332,779.87	1.80
5	601699	潞安环能	12,700,460.70	1.72
6	300070	碧水源	12,400,459.00	1.68
7	002310	东方园林	11,937,431.78	1.62
8	000937	冀中能源	9,470,672.75	1.28
9	601688	华泰证券	9,174,100.81	1.24
10	600109	国金证券	9,086,055.36	1.23
11	600056	中国医药	9,081,807.15	1.23
12	000002	万科A	8,951,692.78	1.21
13	002375	亚厦股份	8,859,242.92	1.20
14	002431	棕榈园林	8,796,365.47	1.19
15	600831	广电网络	8,319,699.61	1.13
16	603001	奥康国际	8,170,121.61	1.11
17	300251	光线传媒	7,682,897.70	1.04
18	600750	江中药业	7,551,293.20	1.02
19	300017	网宿科技	7,392,612.98	1.00
20	600376	首开股份	7,162,036.90	0.97

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	596,347,688.95
卖出股票收入（成交）总额	298,101,036.17

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	38,784,000.00	5.25
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	38,784,000.00	5.25

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101094	11 央行票据 94	400,000	38,784,000.00	5.25

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	932,231.74
5	应收申购款	116,362.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,548,594.16

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

7.9.5 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。

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
9, 189	80, 986. 60	168, 231, 805. 03	22. 61%	575, 954, 021. 16	77. 39%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	谢兰君	2, 000, 444. 00	2. 43%
2	蔡珊珊	2, 000, 250. 00	2. 43%
3	陈将	1, 297, 754. 00	1. 57%
4	曹丽明	1, 244, 125. 00	1. 51%
5	林继煌	1, 010, 112. 00	1. 22%
6	郑仲云	1, 000, 138. 00	1. 21%
7	刘继国	1, 000, 124. 00	1. 21%
8	南京医科大学眼科医院有限公司	855, 222. 00	1. 04%
9	郭颖	853, 154. 00	1. 03%
10	黄小梅	775, 141. 00	0. 94%

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	1,102,447.04	0.1481%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 4 月 5 日）基金份额总额	993,929,233.72
本报告期期初基金份额总额	—
本报告期基金总申购份额	945,176.94
减：本报告期基金总赎回份额	250,688,584.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	744,185,826.19

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）报告期内基金管理人重大人事变动：

经中国证监会批准，王晓明先生任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

（2）报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——安永华明会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	190,890,623.46	21.35%	159,106.74	25.69%	-
国泰君安	2	168,327,874.02	18.83%	108,957.77	17.59%	-
国信证券	1	158,440,973.98	17.72%	101,424.42	16.37%	-
银河证券	1	144,999,033.07	16.22%	96,423.70	15.57%	-
东方证券	1	144,012,649.00	16.11%	96,733.45	15.62%	-
安信证券	2	47,264,503.73	5.29%	30,603.85	4.94%	-
中信证券	1	40,024,532.86	4.48%	26,195.05	4.23%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	380,000,000.00	15.90%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	4,209,217.00	100.00%	480,000,000.00	20.08%	-	-
东方证券	-	-	880,300,000.00	36.83%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	649,700,000.00	27.18%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴全轻资产投资股票型基金 (LOF) 基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 2 月 24 日
2	兴全轻资产投资股票型基金 (LOF) 托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 2 月 24 日
3	兴全轻资产投资股票型基金 (LOF) 招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 2 月 24 日
4	兴全轻资产投资股票型基金 (LOF) 份额发售公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 2 月 24 日
5	关于兴全轻资产基金份额上网发售提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 2 月 27 日
6	关于增加建设银行作为兴全轻资产基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 3 月 2 日
7	关于聘任公司高级管理人员的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2012 年 3 月 6 日

8	关于运用自有资金认购兴全轻资产基金的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 3 月 6 日
9	关于兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 4 月 6 日
10	关于深圳分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 5 月 23 日
11	关于兴全轻资产基金参加部分销售机构申购、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 5 月 28 日
12	关于兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金上市交易公告书	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 5 月 28 日
13	关于兴全轻资产投资股票型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 5 月 28 日
14	关于兴全轻资产投资股票型证券投资基金更正公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 5 月 30 日
15	关于兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 5 月 31 日
16	关于在天相投顾开通旗下基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 6 月 4 日
17	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、基金管理人网站	2012 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《兴全轻资产投资股票型证券投资基金（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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴业全球基金管理有限公司

2012 年 8 月 24 日