

# 兴全有机增长灵活配置 混合型证券投资基金

## 2012 年半年度报告摘要

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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2012 年 8 月 24 日

## § 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。

基金托管人兴业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 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	兴全有机增长混合
基金主代码	340008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 3 月 25 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
报告期末基金份额总额	1,467,468,004.69 份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于有机增长能力强的公司,获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方法,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。并借鉴海外有机增长的研究成果,构建“兴业有机增长筛选系统”,将有机增长投资作为本基金股票组合投资的核心理念。
业绩比较基准	中信标普 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,预计长期平均风险与收益低于股票型证券投资基金,高于可转债、债券型、货币型证券投资基金,属于中高风险、中高收益的证券投资基金品种。

## 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	兴业全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲
	联系电话	021-58368998
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn
客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95561
传真	021-58368858	021-62159217

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyfunds.com.cn">http://www.xyfunds.com.cn</a>
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

## § 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1月1日 - 2012年6月30日)
本期已实现收益	-51,106,889.15
本期利润	54,947,191.26
加权平均基金份额本期利润	0.0338

本期基金份额净值增长率	2.91%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
期末可供分配基金份额利润	0.0365
期末基金资产净值	1,616,738,310.82
期末基金份额净值	1.1017

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。

## 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	-1.30%	1.02%	-2.81%	0.53%	1.51%	0.49%
过去三个月	3.12%	1.01%	0.81%	0.54%	2.31%	0.47%
过去六个月	2.91%	1.11%	3.49%	0.65%	-0.58%	0.46%
过去一年	-7.08%	1.04%	-7.69%	0.67%	0.61%	0.37%
过去三年	8.14%	1.15%	-5.06%	0.77%	13.20%	0.38%
自基金合同生效起至今	10.17%	1.10%	7.81%	0.78%	2.36%	0.32%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中信标普 300 指数选择中国 A 股各行业上市公司中自由流通市值最大、流动性佳且财务稳健的 300 家公司作为样本股，描述了中国 A 股市场的总体趋势。中信国债指数是中信证券股份有限公司编制发布的上海证券交易所国债市场基准指数，样本涵盖剩余期限一年以上的所有上交所市场国债（含浮息券），描述了上交所国债市场的总体趋势。

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：

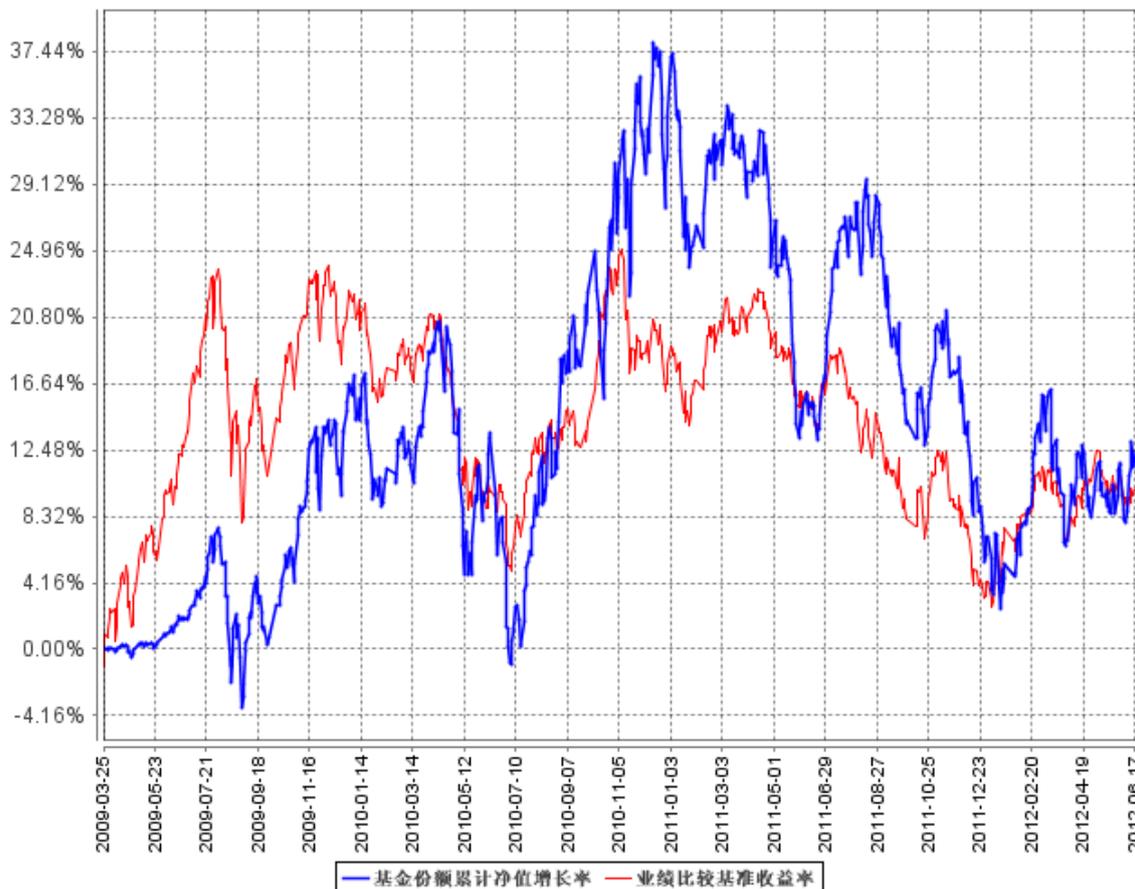
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{中信标普 300 指数}_t / \text{中信标普 300 指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{中信国债指数}_t / \text{中信国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2009 年 3 月 25 日至 2009 年 9 月 25 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

兴业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“兴业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“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业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	本基金和兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金经理	2009 年 3 月 25 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，兴业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、《兴全有机增长灵活配置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 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

上半年主要市场指数大多呈现窄幅震荡行情，但期间热点转换频繁，个股分化显著：一大批股票股价不断创出历史新高的同时，另一大批股票股价接连创出历史新低。

基于对经济以及市场行情相对谨慎的判断，我们重点配置了受宏观经济影响较小的行业，同时进行了较为严格的仓位控制。

一季度，重点配置了网络视频行业取得了较好的收益，但基于对宏观经济的顾虑基本没有配置周期类股，这在一定程度上影响了前期的净值表现。

二季度，市场结构性行情更趋明显，大盘缺乏系统趋势性的机会，行业板块个股之间分化更为显著。我们意识到采取集中的策略要优于分散均衡的策略。因此，有机增长逐步确立了行业集中、个股突出、控制仓位的操作原则。我们认为受宏观经济影响小、业绩增长确定的成长股会具有相对优势。因此集中配置了安防、装饰园林、消费电子、食品饮料这几个细分行业。

从二季度后半期的情况看，采取上述做法的效果是明显的。我们也深知集中配置本身带来的风险可能，而且它几乎必然导致基金净值日间波幅增大，但是争取长期的更好回报显然是我们的首要目标。因此，只要市场依然呈现明显的结构性行情特征，我们就会在今后的运作中完善和坚持这种做法。

#### 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 2.91%，同期业绩比较基准收益率 3.49%。

#### 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》、《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，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遵规守信情况声明

本托管人依据《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自 2009 年 3 月 25 日起托管兴业有机增长灵活配置（即更名后的“兴全有机增长灵活配置”）混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人

在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金  
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	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		120,815,428.26	212,235,510.94
结算备付金		7,347,459.39	7,780,876.75
存出保证金		1,000,000.00	1,278,723.45
交易性金融资产		1,140,605,405.56	1,310,082,977.10
其中：股票投资		1,023,419,670.16	1,001,919,055.30
基金投资		-	-
债券投资		117,185,735.40	308,163,921.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		250,000,000.00	299,000,768.50
应收证券清算款		164,610,000.00	-
应收利息		2,393,507.44	2,134,527.92
应收股利		-	-
应收申购款		292,369.27	24,148,145.02
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,687,064,169.92	1,856,661,529.68

负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		60,034,891.37	50,049,008.10
应付赎回款		3,305,329.81	864,849.70
应付管理人报酬		1,976,931.95	2,347,868.36
应付托管费		329,488.68	391,311.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,027,733.28	1,988,383.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,651,484.01	1,101,490.84
负债合计		70,325,859.10	56,742,911.84
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		1,467,468,004.69	1,681,342,221.28
未分配利润		149,270,306.13	118,576,396.56
所有者权益合计		1,616,738,310.82	1,799,918,617.84
负债和所有者权益总计		1,687,064,169.92	1,856,661,529.68

注: 报告截止日 2012 年 6 月 30 日, 基金份额净值 1.1017 元, 基金份额总额 1,467,468,004.69 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		82,662,336.49	-270,490,129.12
1.利息收入		6,228,377.52	6,067,640.58
其中: 存款利息收入		2,111,276.82	1,687,028.05
债券利息收入		1,998,232.77	1,549,350.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,118,867.93	2,831,261.76
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-29,962,759.90	-129,410,739.23
其中：股票投资收益		-40,546,658.41	-134,307,219.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益		6,443,517.40	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,140,381.11	4,896,480.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		106,054,080.41	-147,788,214.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		342,638.46	641,184.48
<b>减：二、费用</b>		27,715,145.23	34,813,660.73
1.管理人报酬		13,314,409.87	19,871,765.44
2.托管费		2,219,068.28	3,311,960.86
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		12,018,997.96	11,462,515.96
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		162,669.12	167,418.47
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		54,947,191.26	-305,303,789.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		54,947,191.26	-305,303,789.85

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1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）	1,681,342,221.28	118,576,396.56	1,799,918,617.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,947,191.26	54,947,191.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-213,874,216.59	-24,253,281.69	-238,127,498.28

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	202,882,727.63	18,140,308.26	221,023,035.89
2.基金赎回款	-416,756,944.22	-42,393,589.95	-459,150,534.17
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)	1,467,468,004.69	149,270,306.13	1,616,738,310.82
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	2,231,513,507.21	745,717,900.26	2,977,231,407.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-305,303,789.85	-305,303,789.85
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)	-298,309,883.06	-81,371,072.07	-379,680,955.13
其中：1.基金申购款	264,213,659.03	75,400,953.84	339,614,612.87
2.基金赎回款	-562,523,542.09	-156,772,025.91	-719,295,568.00
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)	1,933,203,624.15	359,043,038.34	2,292,246,662.49

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：

          兰荣  杨东  詹鸿飞            
 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

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金(原名兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金)(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[2008]1395 号文《关于核准兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由兴业全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 3 月 25 日正式生效，首次设立募集规模为 1,980,254,871.35 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于 2010 年 1 月 1 日起更名为兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%。

#### 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未租用关联方交易单元，故均未通过关联方交易单元进行交易。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,314,409.87	19,871,765.44
其中：支付销售机构的客户维护费	1,574,498.33	1,970,130.12

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：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,219,068.28	3,311,960.86

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。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.8.4.1 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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 3 月 25 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	43,426,060.93
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	-	43,426,060.93
期末持有的基金份额	-	-

期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
-------------------	---	---

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。

#### 6.4.8.4.2 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及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	120,815,428.26	2,043,341.89	230,543,053.73	1,629,990.99

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
兴业证券	002594	比亚迪	首次公开发行	2,000,000	36,000,000.00

注：本基金上年度可比期间参与了比亚迪股份有限公司（002594）A股发行，该股票此次发行的副主承销商之一兴业证券股份有限公司是本基金管理人的控股股东。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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

6.4.10.1.1 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	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

				类型						
000776	广发 证券	2011 年 8 月 25 日	2012 年 8 月 27 日	非公开 发行流 通受限	26.91	29.35	3,567,000	95,987,970.00	104,691,450.00	-
002672	东江 环保	2012 年 4 月 19 日	2012 年 7 月 26 日	新股流 通受限	43.00	59.00	500,000	21,500,000.00	29,500,000.00	-
300309	吉艾 科技	2012 年 3 月 29 日	2012 年 7 月 10 日	新股流 通受限	31.00	29.34	800,000	24,800,000.00	23,472,000.00	-
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	-

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 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。

##### 6.4.9.3.2 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。

#### 6.4.10 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	1,023,419,670.16	60.66
	其中：股票	1,023,419,670.16	60.66
2	固定收益投资	117,185,735.40	6.95

	其中：债券	117,185,735.40	6.95
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	250,000,000.00	14.82
	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	128,162,887.65	7.60
6	其他各项资产	168,295,876.71	9.98
7	合计	1,687,064,169.92	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	48,106,788.00	2.98
C	制造业	393,124,514.19	24.32
C0	食品、饮料	49,588,811.45	3.07
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	15,087,575.88	0.93
C5	电子	207,137,641.03	12.81
C6	金属、非金属	3,595,566.00	0.22
C7	机械、设备、仪表	8,000.00	0.00
C8	医药、生物制品	117,706,919.83	7.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	150,604,842.54	9.32
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	77,637,848.90	4.80
H	批发和零售贸易	21,874,952.95	1.35
I	金融、保险业	155,336,005.71	9.61
J	房地产业	137,745,211.83	8.52
K	社会服务业	38,989,506.04	2.41
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,023,419,670.16	63.30

### 7.3 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

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	000776	广发证券	3,567,000	104,691,450.00	6.48
2	002415	海康威视	3,695,929	100,529,268.80	6.22
3	002236	大华股份	2,302,561	70,688,622.70	4.37
4	600085	同仁堂	3,505,804	61,176,279.80	3.78
5	300017	网宿科技	3,616,003	58,940,848.90	3.65
6	002482	广田股份	3,000,099	52,351,727.55	3.24
7	002310	东方园林	723,804	42,494,532.84	2.63
8	000848	承德露露	2,206,004	38,715,370.20	2.39
9	600750	江中药业	1,384,273	38,635,059.43	2.39
10	002672	东江环保	500,000	29,500,000.00	1.82

### 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	170,131,507.57	9.45
2	600060	海信电器	118,368,054.06	6.58
3	600088	中视传媒	113,787,458.63	6.32
4	601169	北京银行	104,361,066.10	5.80
5	300017	网宿科技	102,561,354.90	5.70
6	002415	海康威视	91,760,078.38	5.10
7	000537	广宇发展	78,745,770.74	4.37
8	600111	包钢稀土	75,934,752.22	4.22
9	002638	勤上光电	71,446,724.18	3.97
10	002482	广田股份	69,767,801.89	3.88
11	600085	同仁堂	68,415,267.61	3.80
12	600123	兰花科创	68,402,764.13	3.80
13	300251	光线传媒	68,367,953.94	3.80
14	002236	大华股份	66,424,923.18	3.69
15	000937	冀中能源	62,018,965.70	3.45

16	002431	棕榈园林	59,111,450.88	3.28
17	002353	杰瑞股份	58,078,503.04	3.23
18	000527	美的电器	57,966,707.76	3.22
19	000100	TCL 集团	55,622,200.00	3.09
20	300027	华谊兄弟	53,962,025.96	3.00
21	603001	奥康国际	50,756,853.72	2.82
22	600223	鲁商置业	46,918,546.24	2.61
23	600831	广电网络	46,883,934.39	2.60
24	002310	东方园林	44,845,537.75	2.49
25	600048	保利地产	44,203,731.64	2.46
26	600549	厦门钨业	44,071,064.73	2.45
27	600703	三安光电	43,730,906.84	2.43
28	002161	远望谷	43,360,249.48	2.41
29	000402	金融街	43,213,660.42	2.40
30	000686	东北证券	42,064,838.16	2.34
31	002375	亚厦股份	41,624,168.05	2.31
32	600208	新湖中宝	41,093,165.44	2.28
33	600383	金地集团	40,463,233.20	2.25
34	601699	潞安环能	40,040,507.84	2.22
35	600240	华业地产	39,513,552.10	2.20
36	600750	江中药业	39,074,265.35	2.17
37	000783	长江证券	38,660,001.89	2.15
38	000848	承德露露	38,051,650.09	2.11
39	600036	招商银行	37,116,983.66	2.06
40	600970	中材国际	37,046,355.30	2.06
41	600742	一汽富维	36,707,282.58	2.04
42	601901	方正证券	36,455,526.13	2.03

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	172,948,986.78	9.61
2	600637	百视通	158,277,223.14	8.79
3	600088	中视传媒	128,575,208.46	7.14

4	600060	海信电器	124,331,052.43	6.91
5	601169	北京银行	105,201,847.53	5.84
6	600519	贵州茅台	98,479,020.76	5.47
7	002024	苏宁电器	87,554,458.88	4.86
8	000858	五粮液	85,215,464.48	4.73
9	600111	包钢稀土	77,014,320.61	4.28
10	600742	一汽富维	76,464,956.90	4.25
11	600123	兰花科创	76,126,588.31	4.23
12	300251	光线传媒	73,073,984.00	4.06
13	002594	比亚迪	71,389,181.78	3.97
14	002638	勤上光电	70,612,916.16	3.92
15	000537	广宇发展	68,793,618.82	3.82
16	300146	汤臣倍健	66,810,031.51	3.71
17	000527	美的电器	59,367,155.92	3.30
18	000937	冀中能源	54,652,371.03	3.04
19	000100	TCL 集团	54,408,839.99	3.02
20	300027	华谊兄弟	54,034,034.65	3.00
21	300017	网宿科技	51,130,780.59	2.84
22	600240	华业地产	51,001,290.21	2.83
23	000598	兴蓉投资	50,126,579.78	2.78
24	600549	厦门钨业	45,716,495.10	2.54
25	600048	保利地产	44,106,011.22	2.45
26	600703	三安光电	44,080,348.85	2.45
27	600208	新潮中宝	43,653,805.95	2.43
28	600831	广电网络	43,616,182.77	2.42
29	000402	金融街	43,121,375.35	2.40
30	000686	东北证券	41,765,957.69	2.32
31	002161	远望谷	40,993,169.46	2.28
32	002353	杰瑞股份	38,472,717.09	2.14
33	603001	奥康国际	37,573,560.67	2.09
34	600036	招商银行	37,422,027.61	2.08
35	000783	长江证券	37,106,596.53	2.06
36	601699	潞安环能	37,089,760.99	2.06
37	002646	青青稞酒	36,645,834.43	2.04

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	4,140,434,999.84
卖出股票收入（成交）总额	4,186,001,257.41

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	96,910,000.00	5.99
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	20,275,735.40	1.25
8	其他	-	-
9	合计	117,185,735.40	7.25

## 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	1101088	11 央行票据 88	1,000,000	96,910,000.00	5.99
2	110015	石化转债	202,940	20,275,735.40	1.25

## 7.7 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。

## 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	1,000,000.00
2	应收证券清算款	164,610,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	2,393,507.44
5	应收申购款	292,369.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	168,295,876.71

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110015	石化转债	20,275,735.40	1.25

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000776	广发证券	104,691,450.00	6.48	非公开发行
2	002672	东江环保	29,500,000.00	1.82	新股锁定

### 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
38,263	38,352.14	648,613,008.25	44.20%	818,854,996.44	55.80%

### 8.2 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	1,914,234.27	0.1304%

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 50 万份至 100 万份（含）。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年3月25日）基金份额总额	1,980,254,871.35
本报告期期初基金份额总额	1,681,342,221.28
本报告期基金总申购份额	202,882,727.63
减：本报告期基金总赎回份额	416,756,944.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,467,468,004.69

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	
招商证券	1	1,502,030,772.81	18.23%	1,220,410.62	19.35%	-
渤海证券	1	1,429,759,889.86	17.35%	1,222,961.08	19.39%	-
长江证券	1	1,163,199,910.69	14.12%	735,815.91	11.67%	新增
湘财证券	2	1,000,065,641.65	12.14%	822,471.14	13.04%	-
德邦证券	1	877,712,690.63	10.65%	748,591.68	11.87%	-

华泰联合证券	1	559,340,807.80	6.79%	363,569.88	5.76%	-
华创证券	1	472,367,154.24	5.73%	401,509.44	6.37%	-
齐鲁证券	1	441,652,782.17	5.36%	291,002.31	4.61%	-
宏源证券	1	425,346,976.42	5.16%	260,526.29	4.13%	-
中航证券	1	238,878,735.02	2.90%	156,841.34	2.49%	-
东方证券	1	129,672,349.96	1.57%	83,962.74	1.33%	新增
第一创业	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	70,604,675.40	47.76%	250,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	1,652,431.00	1.12%	-	-	-	-
华泰联合证券	1,008,350.00	0.68%	-	-	-	-
华创证券	52,047,427.50	35.20%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	22,530,905.50	15.24%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司

2012 年 8 月 24 日