

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:2014年1月21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。  
本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2014年1月20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，保证复核结果不存在虚假记载、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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称	兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)
基金主代码	163412
交易代码	163412
前端交易代码	163413
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6日
报告期末基金份额总额	399,801,031.45份

本基金将股票“资产配置”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

在各类资产配置上，本基金将稳定性与定期组合结合，在股票与债券资产之间进行资产配置；并运用量化方法对股票资产进行配置，同时根据市场情况适时调整资产配置比例。

基金经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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2013年10月1日 - 2013年12月31日)
1.本期已实现收益	-14,635,045.63
2.本期利润	-75,687,171.71
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1952
4.期末基金份额净值	558,161,163.23
5.期末基金份额净值	1.397

3.2.1 本期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变动的比较

阶段 净值增长率(①) 业绩比较基准收益率(②) 收益率差额(③=①-②) 收益率差额标准差(④) ①-④

过去三个月 -10.51% 2.09% -3.11% 0.90% -7.40% 1.19%

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

单位:人民币元

注:1、净值表现所取数据截至到2013年12月31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，本基金建仓期为2012年4月6日至2013年6月30日，期间本基金的各项投资比例限制和投资组合的比例如下：

本基金将股票“资产配置”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

基金经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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

### § 4 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

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、所述基金绩效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)，计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期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变动的比较

阶段 净值增长率(①) 业绩比较基准收益率(②) 收益率差额(③=①-②) 收益率差额标准差(④) ①-④

过去三个月 0.95% 0.92% -0.09% 0.58% 3.04% 0.34%

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

单位:人民币元

注:1、净值表现所取数据截至到2013年12月31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，本基金建仓期为2012年4月6日至2013年6月30日，期间本基金的各项投资比例限制和投资组合的比例如下：

本基金将股票“资产配置”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

基金经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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

### § 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

单位:人民币元

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、所述基金绩效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)，计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本期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变动的比较

阶段 净值增长率(①) 业绩比较基准收益率(②) 收益率差额(③=①-②) 收益率差额标准差(④) ①-④

过去三个月 0.95% 0.92% -0.09% 0.58% 3.04% 0.34%

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

单位:人民币元

注:1、净值表现所取数据截至到2013年12月31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，本基金建仓期为2012年4月6日至2013年6月30日，期间本基金的各项投资比例限制和投资组合的比例如下：

本基金将股票“资产配置”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

基金经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。

本报告期自2013年10月1日起至12月31日止。

### § 6 报告期内基金投资组合报告

6.1 管理人报告

6.1.1 基金管理人报告期内的基金投资策略和运作分析

本基金在三季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.1.2 风险揭示及未来投资方向

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.1.3 未来不确定因素可能存在的影响分析

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.1.4 其他需要说明的因素

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.2 基金管理人关于基金估值方法的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.3 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.4 基金管理人关于基金费用计提方法、计提标准、计提方式、暂停计提或免除计提的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.5 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.6 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.7 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.8 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.9 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.10 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.11 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.12 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.13 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.14 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.15 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.16 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.17 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.18 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.19 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.20 基金管理人关于基金收益分配政策的说明

本基金在四季度整体表现较好，依然保持较低仓位，着力防御。主要的操作是对组合进行了优化，把三季报较差的公司进行了减持，增持了三季报表现较好的公司。另外，为2014年布局，增持了部分消费股和龙头成长股。

6.21 基金管理人关于基金收益分配政策的说明