

兴全可转债混合型证券投资基金

[2013] 第四季度报告

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:2014年1月21日

5.1 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，保留下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未来表现。投资人投资本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

报告内容未经审计。

报告期为2013年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称 兴全可转债混合

基金主代码 340001

交易代码 340001

基金运作方式 契约型开放式

基金合同期效日 2004年5月11日

报告期初基金份额总额 473,615,007.01

投资目标 在锁定投资组合下方风险的基础上,以有限的期权成本获取基金整体的长期增值。

基金的资产配置采用自上而下的程序,债券和个股选择采用自上而下的程序,并严格控制投资风险。在个券选择层面,积极寻求与发行条款优惠、期限价值较高、公司基本面优秀的可转债品种;选股时,选择对公司的股价走势有较大影响的行业,以有效规避市场风格波动,部分持有股票资产的上涨收益,运用“可转债溢价率”分析为核心,选择适合行业发展前景较好的、价值被相对低估的股票进行投资。

80%×该类可转债指数+15%×中证标普300指数+5%×同业存款利率

本基金的风险水平处于市场低端,收益水平处于市场中端。

兴业全球基金管理有限公司

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

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 41,272,994.45

2.本期利润 -15,179,312.41

3.期初平均基金份额本期利润 -0.0056

4.期末基金份额净值 2,783,761,024.78

1.1254

5.期末可供分配基金份额利润 4,000,000.00

6.期末可供分配利润 4,000,000.00

7.期末基金资产净值 2,783,761,024.78

8.期末基金份额净值 2,783,761,024.78

9.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

10.期末基金资产总值 2,783,761,024.78

11.期末基金份额净值 2,783,761,024.78

12.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

13.期末基金资产净值 2,783,761,024.78

14.期末基金份额净值 2,783,761,024.78

15.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

16.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

17.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

18.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

19.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

20.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

21.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

22.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

23.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

24.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

25.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

26.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

27.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

28.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

29.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

30.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

31.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

32.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

33.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

34.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

35.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

36.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

37.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

38.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

39.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

40.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

41.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

42.期末可供分配基金份额净额 4,000,000.00

43.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

44.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

45.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

46.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

47.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

48.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

49.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

50.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

51.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

52.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

53.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

54.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

55.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

56.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

57.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

58.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

59.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

60.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

61.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

62.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

63.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

64.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

65.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

66.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

67.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

68.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

69.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

70.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

71.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

72.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

73.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

74.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

75.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

76.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

77.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

78.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

79.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

80.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

81.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

82.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

83.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

84.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

85.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

86.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

87.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

88.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

89.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

90.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

91.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

92.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

93.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

94.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

95.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

96.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

97.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

98.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

99.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

100.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

101.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

102.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

103.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

104.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

105.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

106.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

107.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

108.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

109.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

110.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

111.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

112.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

113.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

114.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

115.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

116.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

117.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

118.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

119.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

120.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

121.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

122.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

123.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

124.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

125.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

126.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

127.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

128.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

129.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

130.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.00

131.期末可供分配基金份额总额 4,000,000.