兴全货币市场证券投资基金

【2014】第一季度报告

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年4月19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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全货币
基金主代码	340005
交易代码	340005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年4月27日
报告期末基金份额总额	1,640,516,994.94份
投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上,使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等,使基金收益达到同期货币市场的收益水平,力争超越业绩比较基准。
投资策略	本基金通过对货币市场短期金融工具的积极稳健投资,在风险和收益中寻找最优组合,在保持本金安全与资产充分流动性的前提下,综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资,追求稳定的现金收益。
业绩比较基准	税后6个月银行定期存款利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。
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

§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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1. 本期已实现收益	15,464,319.83
2.本期利润	15,464,319.83
3.期末基金资产净值	1,640,516,994.94

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

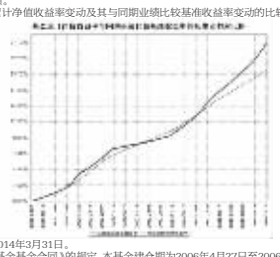
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2414%	0.0042%	0.6904%	0.0000%	0.5510%	0.0042%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年3月31日。

2、按照《兴全货币市场证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2006年4月27日至2006年10月26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本基金投资组合的比例范围。

§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		
张睿	本基金和兴全保本混合型证券投资基金、兴全添利宝货币市场基金基金经理	2012年6月29日	-	9年	1981年生,经济学硕士,历任红顶金融工程研究中心研究部经理,申银万国证券研究所高级分析师,兴业全球基金管理有限公司研究员。

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 管理人对投资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、《兴全货币市场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,本基金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

报告期内,市场经历了一轮较为明显的修正过程,主要是以创业板为代表的成长股热热闹闹上涨后出现幅度较大的调整,以及部分低估值大盘股出现反弹。本基金管理人总体上坚持了去年底以来的主线,也意识到2月份市场上乱糟糟的题材股票上涨最终应该是一地鸡毛。基金进行了仓位和结构的适当调整,主要是增加了而稳定增长的食品饮料行业投资,我们认为该行业相对低的估值和稳定的成长性开始出现一定的相对优势。

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3.95%,同期业绩比较基准收益率为-5.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于年报中提到的转型和挤出逻辑,本基金管理人继续对2014年保持不悲观的态度,在策略上更加侧重具有良好景气度和成长性的行业和公司的挖掘,对于有实际业绩成长支撑的股票保持了坚定持有,同时还适当关注国企改革、稳增长措施带来的投资机会。总体上,选择具有长期成长空间的公司,保持精耕细作以及一定的逆向思维是有益于组合的。

§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	1,684,604,346.52	85.82
	其中:股票	1,684,604,346.52	85.82
2	固定收益投资	203,184,703.40	10.35
	其中:债券	203,184,703.40	10.35
	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	51,985,894.35	2.65
7	其他资产	23,068,246.93	1.18
8	合计	1,962,843,191.20	100.00

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	65.92	9.92
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	22.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	9.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	5.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	3.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	107.37	9.92

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	摊余成本(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	89,852,850.91	5.48
	其中:政策性金融债	89,852,850.91	5.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	480,460,757.73	29.29
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	570,313,608.64	34.76
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	071408002	14东方证券CP002	700,000	70,101,076.17	4.27
2	071401002	14招商CP002	500,000	50,108,500.28	3.05
3	071430001	14财通证券CP001	500,000	50,087,150.31	3.05
4	071401003	14招商CP003	500,000	50,081,773.71	3.05
5	071428002	14万正证券CP002	300,000	30,046,110.57	1.83
6	041361017	13建发集CP001	300,000	30,040,579.92	1.83
7	071423001	14长城证券CP001	300,000	30,003,272.25	1.83
8	130218	13国开18	300,000	29,992,754.78	1.83
9	041359069	13闽能源CP003	300,000	29,984,043.38	1.83
10	041361023	13建发集CP002	300,000	29,971,609.19	1.83

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1437%
报告期内偏离度的最低值	-0.0287%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0735%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法,固估值对象以买入成本列示,按照实际利率每日计提应收利息,2007年7月1日前按直线法,2007年7月1日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查。

5.8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,328,397.15
4	应收申购款	39,374,426.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	50,702,823.33

5.8.5 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	1,778,060,566.67
报告期期间基金总申购份额	2,627,270,426.42
减:报告期期间基金总赎回份额	2,764,813,998.15
报告期期末基金份额总额	1,640,516,994.94

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 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2014年1月10日	169,221.08	169,221.08	-
2	赎回	2014年1月15日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
3	赎回	2014年1月27日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
4	红利再投	2014年2月10日	154,380.76	154,380.76	-
5	申购	2014年2月12日	46,000,000.00	46,000,000.00	-
6	赎回	2014年2月17日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	-
7	赎回	2014年2月20日	-16,000,000.00	-16,000,000.00	-
8	赎回	2014年2月28日	-13,000,000.00	-13,000,000.00	-
9	赎回	2014年3月10日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
10	红利再投	2014年3月10日	141,460.28	141,460.28	-
11	申购	2014年3月12日	60,000,000.00	60,000,000.00	-
12	申购	2014年3月17日	6,000,000.00	6,000,000.00	-
13	申购	2014年3月21日	58,000,000.00	58,000,000.00	-
14	赎回	2014年3月28日	-15,000,000.00	-15,000,000.00	-
合计			71,465,062.12	71,465,062.12	

§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、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》

3、《兴全货币市场证券投资基金托管协议》

4、《兴全货币市场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、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
2014年4月19日

兴全可转债混合型证券投资基金

【2014】第一季度报告

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4月19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2014年4月18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2014年1月1日起至3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
基金合同生效日	2004年5月11日
报告期末基金份额总额	2,308,547,851.51份
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资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序,个券和个股选择采用自下而上的程序,并严格控制投资风险。在个券选择层面,积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购;选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础较原有着较高上涨预期的可转债进行投资,以有效规避市场风险,并充分分享股市上涨的收益;运用"兴全可转债评价体系",选择定价失衡的个券进行投资,实现低风险的套利。在个股选择层面,以"相对投资价值"判断为核心,选择处于行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×天相可转债指数+15%×中信标普300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端,收益水平处于市场中高端。
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	88,667,878.02
2.本期利润	44,409,897.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0187
4.期末基金资产净值	2,567,237,469.58
5.期末基金份额净值	1.1121

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。

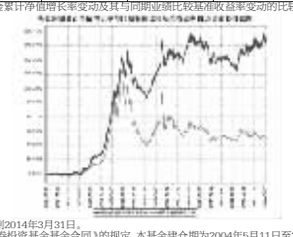
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	1.47%	0.76%	-1.93%	0.53%	3.40%	0.23%

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2014年3月31日。

2、按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2004年5月11日至2004年11月10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		
杨云	基金管理部副总监、本基金和兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2007年2月6日	-	12年	1974年生,理学硕士,历任申银万国证券研究所金融工程部、策略部研究员;兴全可转债混合型证券投资基金的基金经理助理。

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 管理人对投资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、《兴全可转债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

一季度,除了创业板指数表现优异外,沪深主板及中小板指数都出现了明显的回调,而且一路强势的创业板也走出了冲高回落的走势。盘面上市场热点变得快速轮换,持续性减弱。以炒作和并购题材为特征的各种概念故事股一季度脉冲行情较为抢眼,但从历史来看通常都是投机的强弩之末。行业层面上,以互联网为代表的信息服务、信息设备以及机器人概念的机械设备等板块表现优异,都有超过10%的涨幅。采掘和农业受基本面持续恶化的影响,跌幅较大。

进入2014年一季度资金面突然变得异常宽松,但经过2013年整个下半年的资金紧张,大量投资者对资金面可能的变化仍心存余悸。债券市场短端利率大幅下行,而中长端的收益率变动并不明显,收益率曲线变得陡峭。转债市场变主板市场的下跌仍是下跌走势,但大量转债由于收益率的逐步抬高,价格钝化日益明显,转债指数一季度下跌-1.12%。

基金一季度的大类资产配置变化较大,主要为基金大幅下降了股票的持仓比例,同时大比例地提高了转债持仓比例。基金在股票持仓上相对偏新兴成长,一季度随着一些持仓股走势超预期,基金做了大比例的减持,另一方面,大量转债特别是一些大盘转债收益率日益抬高,而转股溢价率并没有被大幅抬高,基金转而大比例地增持了转债,在回购利率持续较低的情况下基金对转债投资进行了一定比例的放大配置,主要基于对这些转债收益率已足够安全的判断。

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-1.18%,同期业绩比较基准收益率为-1.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在2013年的年报中我们曾写道:赚钱效应是投资者近迟不肯离场的主要原因,而一些优质成长股龙头其实已开始悄然回调,一季度主要是补涨的各种故事支撑着市场的热度。从目前时点来看,我们认为成长股在经过一年多时间的上涨后,在估值和涨幅上都有很大的透支,而且其中充斥着无数值目程杂的为成长股,这些个股如果回调可能带来整体的泥沙俱下,目前环境下适当回避成长股应该是恰当的,优质的成长股会有好的买入时机。而一直被压抑的大盘蓝筹股会因为调整幅度大、调整时间长和估值足够低而带来阶段性的博弈机会。目前的转债无论是溢价还是纯债收益率都非常具有吸引力,作为对蓝筹股的替代是非常有价值的。

§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	469,767,620.73	14.65
	其中:股票	469,767,620.73	14.65
2	固定收益投资	2,615,231,046.09	81.56
	其中:债券	2,615,231,046.09	81.56
	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	104,797,598.15	3.27
7	其他资产	16,665,261.21	0.52
8	合计	3,206,461,526.18	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	346,976,574.17	13.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,080,374.02	0.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	91,630,820.30	3.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,079,852.24	0.51
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	469,767,620.73	18.30

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	002594	比亚迪	1,600,000	76,976,000.00	3.00
2	600079	人福医药	2,499,906	68,647,418.76	2.67
3	300124	汇川技术	800,000	56,824,000.00	2.21
4	300017	网宿科技	500,000	52,540,000.00	2.05
5	002439	启明星辰	1,254,922	39,090,820.30	1.52
6	002638	勤上光电	2,800,000	31,500,000.00	1.23
7	002570	贝因美	974,920	25,728,138.80	1.00
8	000733	振华科技	1,677,600	18,436,824.00	0.72
9	600323	瀚蓝环境	1,720,302	18,080,374.02	0.70
10	601799	星宇股份	868,489	16,648,934.13	0.65

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	40,000,000.00	1.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,870,000.00	3.89
	其中:政策性金融债	99,870,000.00	3.89
4	企业债券	27,024,018.95	1.05
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,448,337,027.14	95.37
8	其他	-	-
9	合计	2,615,231,046.09	101.87

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	113001	中行转债	9,064,170	887,654,168.10	34.58
2	110015	石化转债	6,311,510	646,109,278.70	25.17
3	113005	平安转债	3,551,730	351,088,510.50	13.68
4	110018	国电转债	1,436,610	148,401,813.00	5.78
5	110024	隧道转债	1,117,340	115,544,129.40	4.50

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	1,350,414.27
2	应收证券清算款	9,465,951.41
3	应收股利	-
4	应收利息	2,495,457.14
5	应收申购款	9,756,424.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,068,246.93

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110015	石化转债	51,185,000.00	2.66
2	110023	民生转债	41,116,435.40	2.14

5.11.5 报告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。

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	2,473,615,007.01
报告期期间基金总申购份额	92,174,511.16
减:报告期期间基金总赎回份额	257,241,666.66
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	2,308,547,851.51

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	62,563,900.45
报告期期间买入/申购总份额	1,663,786.02
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	64,227,686.47
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.78

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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2014年3月13日	1,663,786.02	1,876,917.01	-
合计			1,663,786.02	1,876,917.01	

注:"交易日期"为交易确认日或分红权益登记日。

§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、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》

3、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》

4、《兴全可转债混合型证券投资基金更新招募说明书》

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
2014年4月19日

兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)

【2014】第一季度报告

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4月19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2014年4月18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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资股票(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	1,407,399,479.62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	本基金为股票型基金产品,属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种,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。
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(2014年1月1日 - 2014年3月31日)
1.本期已实现收益	143,281,464.97
2.本期利润	77,527,933.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0533
4.期末基金资产净值	1,923,416,813.13
5.期末基金份额净值	1.367

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	3.95%	1.53%	-5.89%	0.95%	9.84%	0.58%

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