

兴全保本混合型证券投资基金

2014 第一季度报告

基金管理人:兴全基金管理有限公司
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

5.1 重要提示
基金管理人兴全基金管理有限公司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法律责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期内基金未发生诉讼。
本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

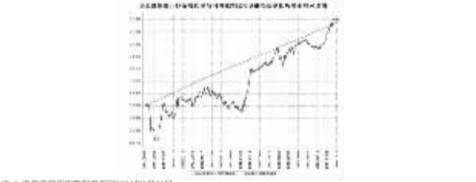
基金简称	兴全保本混合
基金主代码	163411
交易代码	163411
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月3日
报告期末基金份额总额	446,223,080.01份
投资目标	本基金通过特定组合投资策略,在确保保本周期内的保本收益的基础上,寻求组合资产的稳定增长。
投资策略	1. 基于可转换投资的策略,以可转债所隐含的看涨期权为投资重点,合理配置可转债资产,利用可转债自身特性来避免因为调整调整低风险资产与高风险资产比例带来的交易成本。 2. 可转债与股票替代的TIP策略,即采用固定成长性投资组合策略来管理本基金资产,同时,本基金选择转债投资比例较小的可转债进行投资,但可转债市场无投资机会时,本基金将使用股票资产部分或现金替代可转债的TIP策略来实施组合风险控制。
业绩比较基准	3年期定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金联系人	重庆市三峡担保集团有限公司

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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	16,783,980.24
2.本期利润	20,195,579.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0427
4.期末基金资产净值	505,638,876.26
5.期末基金份额净值	1.1332

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.本报告期末基金份额持有人认购及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低于所列数字。
3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④	
过去三个月	3.88%	0.17%	1.07%	0.01%	2.81%	0.16%



注:1.净值表现所披露数据截至2014年3月31日。
2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2011年8月3日至2012年2月2日,建仓期结束时本基金投资组合比例符合基金合同规定的投资组合比例及投资策略的有关比例及各项要求。
3.2 基金净值表现

5.4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨云	基金管理部副总监,本基金和兴全可转债混合型证券投资基金基金经理	2011年8月3日	-	12年	1974年生,理学硕士,历任中国南方证券研究所金融工程部经理,策略研究员,兴全可转债混合型证券投资基金基金经理。
陈晖	本基金和兴全可转债混合型证券投资基金基金经理	2013年7月1日	-	9年	1981年生,经济学硕士,历任工商银行总行研发中心研究员,中银国际证券研究所高级分析师,兴全全球基金基金经理。

1.1 报告期内基金投资运作及业绩表现
1.2 报告期内基金管理人及基金经理的简介
1.3 基金管理人及基金经理的从业经历
1.4 基金管理人及基金经理的从业经历
1.5 基金管理人及基金经理的从业经历
1.6 基金管理人及基金经理的从业经历
1.7 基金管理人及基金经理的从业经历
1.8 基金管理人及基金经理的从业经历
1.9 基金管理人及基金经理的从业经历
1.10 基金管理人及基金经理的从业经历
1.11 基金管理人及基金经理的从业经历
1.12 基金管理人及基金经理的从业经历
1.13 基金管理人及基金经理的从业经历
1.14 基金管理人及基金经理的从业经历
1.15 基金管理人及基金经理的从业经历
1.16 基金管理人及基金经理的从业经历
1.17 基金管理人及基金经理的从业经历
1.18 基金管理人及基金经理的从业经历
1.19 基金管理人及基金经理的从业经历
1.20 基金管理人及基金经理的从业经历
1.21 基金管理人及基金经理的从业经历
1.22 基金管理人及基金经理的从业经历
1.23 基金管理人及基金经理的从业经历
1.24 基金管理人及基金经理的从业经历
1.25 基金管理人及基金经理的从业经历
1.26 基金管理人及基金经理的从业经历
1.27 基金管理人及基金经理的从业经历
1.28 基金管理人及基金经理的从业经历
1.29 基金管理人及基金经理的从业经历
1.30 基金管理人及基金经理的从业经历
1.31 基金管理人及基金经理的从业经历
1.32 基金管理人及基金经理的从业经历
1.33 基金管理人及基金经理的从业经历
1.34 基金管理人及基金经理的从业经历
1.35 基金管理人及基金经理的从业经历
1.36 基金管理人及基金经理的从业经历
1.37 基金管理人及基金经理的从业经历
1.38 基金管理人及基金经理的从业经历
1.39 基金管理人及基金经理的从业经历
1.40 基金管理人及基金经理的从业经历
1.41 基金管理人及基金经理的从业经历
1.42 基金管理人及基金经理的从业经历
1.43 基金管理人及基金经理的从业经历
1.44 基金管理人及基金经理的从业经历
1.45 基金管理人及基金经理的从业经历
1.46 基金管理人及基金经理的从业经历
1.47 基金管理人及基金经理的从业经历
1.48 基金管理人及基金经理的从业经历
1.49 基金管理人及基金经理的从业经历
1.50 基金管理人及基金经理的从业经历
1.51 基金管理人及基金经理的从业经历
1.52 基金管理人及基金经理的从业经历
1.53 基金管理人及基金经理的从业经历
1.54 基金管理人及基金经理的从业经历
1.55 基金管理人及基金经理的从业经历
1.56 基金管理人及基金经理的从业经历
1.57 基金管理人及基金经理的从业经历
1.58 基金管理人及基金经理的从业经历
1.59 基金管理人及基金经理的从业经历
1.60 基金管理人及基金经理的从业经历
1.61 基金管理人及基金经理的从业经历
1.62 基金管理人及基金经理的从业经历
1.63 基金管理人及基金经理的从业经历
1.64 基金管理人及基金经理的从业经历
1.65 基金管理人及基金经理的从业经历
1.66 基金管理人及基金经理的从业经历
1.67 基金管理人及基金经理的从业经历
1.68 基金管理人及基金经理的从业经历
1.69 基金管理人及基金经理的从业经历
1.70 基金管理人及基金经理的从业经历
1.71 基金管理人及基金经理的从业经历
1.72 基金管理人及基金经理的从业经历
1.73 基金管理人及基金经理的从业经历
1.74 基金管理人及基金经理的从业经历
1.75 基金管理人及基金经理的从业经历
1.76 基金管理人及基金经理的从业经历
1.77 基金管理人及基金经理的从业经历
1.78 基金管理人及基金经理的从业经历
1.79 基金管理人及基金经理的从业经历
1.80 基金管理人及基金经理的从业经历
1.81 基金管理人及基金经理的从业经历
1.82 基金管理人及基金经理的从业经历
1.83 基金管理人及基金经理的从业经历
1.84 基金管理人及基金经理的从业经历
1.85 基金管理人及基金经理的从业经历
1.86 基金管理人及基金经理的从业经历
1.87 基金管理人及基金经理的从业经历
1.88 基金管理人及基金经理的从业经历
1.89 基金管理人及基金经理的从业经历
1.90 基金管理人及基金经理的从业经历
1.91 基金管理人及基金经理的从业经历
1.92 基金管理人及基金经理的从业经历
1.93 基金管理人及基金经理的从业经历
1.94 基金管理人及基金经理的从业经历
1.95 基金管理人及基金经理的从业经历
1.96 基金管理人及基金经理的从业经历
1.97 基金管理人及基金经理的从业经历
1.98 基金管理人及基金经理的从业经历
1.99 基金管理人及基金经理的从业经历
1.100 基金管理人及基金经理的从业经历

5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,817,234.00	0.46
2	固定收益投资	422,510,947.86	68.70
3	其中:债券	422,510,947.86	68.70
4	资产支持证券	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	2,000,000.00	0.33
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	176,813,082.05	28.75
9	其他资产	10,891,787.40	1.77
10	合计	615,033,051.31	100.00

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	矿业	-	-
C	制造业	2,817,234.00	0.46
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
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		2,817,234.00	0.46

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	600318	中国平安	1,350,000	50,706,000.00	5.18
2	600036	招商银行	4,027,000	39,643,340.00	4.05
3	600000	浦发银行	3,710,000	36,061,200.00	3.68
4	600016	民生银行	4,520,000	34,623,200.00	3.53
5	000895	双汇发展	799,900	31,428,071.00	3.21
6	601166	兴业银行	3,107,000	29,578,600.00	3.02
7	601328	交通银行	5,630,000	21,281,400.00	2.17
8	600109	国金证券	997,000	18,564,140.00	1.89
9	601088	中国神华	1,172,000	16,208,760.00	1.65
10	000002	万科A	1,977,000	15,993,930.00	1.63

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十名债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130263	13国开36	20,000	19,978,000.00	2.04
2	130243	13国开43	20,000	19,974,000.00	2.04
3	113005	平安转债	50,000	4,942,500.00	0.50
4	110053	石化转债	27,000	2,584,066.00	0.26
5	113002	工行转债	23,000	2,254,000.00	0.23
6	600775	南京高科	110,000	822,800.00	0.08

5.9 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股指期货投资明细

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	130263	13国开36	20,000	19,978,000.00	2.04
2	130243	13国开43	20,000	19,974,000.00	2.04
3	113005	平安转债	50,000	4,942,500.00	0.50
4	110053	石化转债	27,000	2,584,066.00	0.26
5	113002	工行转债	23,000	2,254,000.00	0.23

5.10 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资产支持证券投资明细

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	130263	13国开36	20,000	19,978,000.00	2.04
2	130243	13国开43	20,000	19,974,000.00	2.04
3	113005	平安转债	50,000	4,942,500.00	0.50
4	110053	石化转债	27,000	2,584,066.00	0.26
5	113002	工行转债	23,000	2,254,000.00	0.23

兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)

2014 第一季度报告

基金管理人:兴全基金管理有限公司
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

5.1 重要提示
基金管理人兴全基金管理有限公司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法律责任。
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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期内基金未发生诉讼。
本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

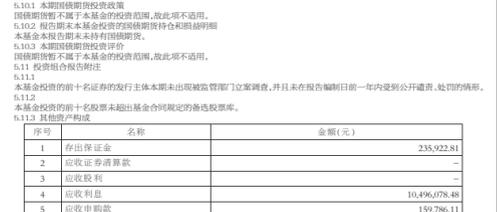
基金简称	兴全沪深300增强
基金主代码	163406
交易代码	163406
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月22日
报告期末基金份额总额	964,191,087.92份
投资目标	本基金通过定性分析与定量相结合精选股票,以追求当期收益与实现长期资本增值。
投资策略	本基金以定性分析与定量分析相结合,在股票与债券等资产类别之间进行资产配置,以追求当期收益与实现长期资本增值。本基金通过动态跟踪国内主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等非市场指标,确定市场可投资趋势。本基金通过多因素模型,从基本面、估值、市场情绪、政策、对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行判断。
业绩比较基准	80%沪深300指数+20%中债国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,预期收益和预期风险均较高,属于较高风险、较高收益的基金品种。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
基金联系人	重庆市三峡担保集团有限公司

5.3 主要财务指标和基金净值表现

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	68,719,898.91
2.本期利润	15,754,491.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0172
4.期末基金资产净值	1,153,968,302.58
5.期末基金份额净值	1.1968

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.本报告期末基金份额持有人认购及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低于所列数字。
3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④	
过去三个月	1.84%	1.14%	-5.89%	0.95%	7.73%	0.19%



注:1.净值表现所披露数据截至2014年3月31日。
2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2010年4月22日至2010年10月21日,建仓期结束时本基金投资组合比例符合基金合同规定的投资组合比例及投资策略的有关比例及各项要求。
3.2 基金净值表现

5.4 管理人报告

姓名	职务	任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
陈治宇	本基金基金经理	2013年1月29日	-	6年	1981年生,经济学硕士,2007年加入兴全基金管理有限公司,历任行业研究员,专户投资部投资经理。

1.1 报告期内基金投资运作及业绩表现
1.2 报告期内基金管理人及基金经理的简介
1.3 基金管理人及基金经理的从业经历
1.4 基金管理人及基金经理的从业经历
1.5 基金管理人及基金经理的从业经历
1.6 基金管理人及基金经理的从业经历
1.7 基金管理人及基金经理的从业经历
1.8 基金管理人及基金经理的从业经历
1.9 基金管理人及基金经理的从业经历
1.10 基金管理人及基金经理的从业经历
1.11 基金管理人及基金经理的从业经历
1.12 基金管理人及基金经理的从业经历
1.13 基金管理人及基金经理的从业经历
1.14 基金管理人及基金经理的从业经历
1.15 基金管理人及基金经理的从业经历
1.16 基金管理人及基金经理的从业经历
1.17 基金管理人及基金经理的从业经历
1.18 基金管理人及基金经理的从业经历
1.19 基金管理人及基金经理的从业经历
1.20 基金管理人及基金经理的从业经历
1.21 基金管理人及基金经理的从业经历
1.22 基金管理人及基金经理的从业经历
1.23 基金管理人及基金经理的从业经历
1.24 基金管理人及基金经理的从业经历
1.25 基金管理人及基金经理的从业经历
1.26 基金管理人及基金经理的从业经历
1.27 基金管理人及基金经理的从业经历
1.28 基金管理人及基金经理的从业经历
1.29 基金管理人及基金经理的从业经历
1.30 基金管理人及基金经理的从业经历
1.31 基金管理人及基金经理的从业经历
1.32 基金管理人及基金经理的从业经历
1.33 基金管理人及基金经理的从业经历
1.34 基金管理人及基金经理的从业经历
1.35 基金管理人及基金经理的从业经历
1.36 基金管理人及基金经理的从业经历
1.37 基金管理人及基金经理的从业经历
1.38 基金管理人及基金经理的从业经历
1.39 基金管理人及基金经理的从业经历
1.40 基金管理人及基金经理的从业经历
1.41 基金管理人及基金经理的从业经历
1.42 基金管理人及基金经理的从业经历
1.43 基金管理人及基金经理的从业经历
1.44 基金管理人及基金经理的从业经历
1.45 基金管理人及基金经理的从业经历
1.46 基金管理人及基金经理的从业经历
1.47 基金管理人及基金经理的从业经历
1.48 基金管理人及基金经理的从业经历
1.49 基金管理人及基金经理的从业经历
1.50 基金管理人及基金经理的从业经历
1.51 基金管理人及基金经理的从业经历
1.52 基金管理人及基金经理的从业经历
1.53 基金管理人及基金经理的从业经历
1.54 基金管理人及基金经理的从业经历
1.55 基金管理人及基金经理的从业经历
1.56 基金管理人及基金经理的从业经历
1.57 基金管理人及基金经理的从业经历
1.58 基金管理人及基金经理的从业经历
1.59 基金管理人及基金经理的从业经历
1.60 基金管理人及基金经理的从业经历
1.61 基金管理人及基金经理的从业经历
1.62 基金管理人及基金经理的从业经历
1.63 基金管理人及基金经理的从业经历
1.64 基金管理人及基金经理的从业经历
1.65 基金管理人及基金经理的从业经历
1.66 基金管理人及基金经理的从业经历
1.67 基金管理人及基金经理的从业经历
1.68 基金管理人及基金经理的从业经历
1.69 基金管理人及基金经理的从业经历
1.70 基金管理人及基金经理的从业经历
1.71 基金管理人及基金经理的从业经历
1.72 基金管理人及基金经理的从业经历
1.73 基金管理人及基金经理的从业经历
1.74 基金管理人及基金经理的从业经历
1.75 基金管理人及基金经理的从业经历
1.76 基金管理人及基金经理的从业经历
1.77 基金管理人及基金经理的从业经历
1.78 基金管理人及基金经理的从业经历
1.79 基金管理人及基金经理的从业经历
1.80 基金管理人及基金经理的从业经历
1.81 基金管理人及基金经理的从业经历
1.82 基金管理人及基金经理的从业经历
1.83 基金管理人及基金经理的从业经历
1.84 基金管理人及基金经理的从业经历
1.85 基金管理人及基金经理的从业经历
1.86 基金管理人及基金经理的从业经历
1.87 基金管理人及基金经理的从业经历
1.88 基金管理人及基金经理的从业经历
1.89 基金管理人及基金经理的从业经历
1.90 基金管理人及基金经理的从业经历
1.91 基金管理人及基金经理的从业经历
1.92 基金管理人及基金经理的从业经历
1.93 基金管理人及基金经理的从业经历
1.94 基金管理人及基金经理的从业经历
1.95 基金管理人及基金经理的从业经历
1.96 基金管理人及基金经理的从业经历
1.97 基金管理人及基金经理的从业经历
1.98 基金管理人及基金经理的从业经历
1.99 基金管理人及基金经理的从业经历
1.100 基金管理人及基金经理的从业经历

5.5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	871,503,497.13	75.20
2	其中:股票	871,503,497.13	75.20
3	固定收益投资	269,911,239.70	23.29
4	其中:债券	269,911,239.70	23.29
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	14,344,375.16	1.24
10	合计	1,153,898,775.86	100.00

5.6 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	矿业	-	-
C	制造业	15,335,360.00	1.39
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
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	-	-
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	-	-
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		47,822,610.00	4.18

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	600318	中国平安	1,350,000	50,706,000.00	5.18
2	600036	招商银行	4,027,000	39,643,340.00	4.05
3	600000	浦发银行	3,710,000	36,061,200.00	3.68
4	600016	民生银行	4,520,000	34,623,200.00	3.53
5	000895	双汇发展	799,900	31,428,071.00	3.21
6	601166	兴业银行	3,107,000	29,578,600.00	3.02
7	601328	交通银行	5,630,000	21,281,400.00	2.17
8	600109	国金证券	997,000	18,564,140.00	1.89
9	601088	中国神华	1,172,000	16,208,760.00	1.65
10	000002	万科A	1,977,000	15,993,930.00	1.63

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十名债券投资明细

序号	股票代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130263	13国开36	20,000	19,978,000.00	2.04
2	130243	13国开43	20,000	19,974,000.00	2.04
3	113005	平安转债	50,000	4,942,500.00	0.50
4	110053	石化转债	27,000	2,584,066.00	0.26
5	113002	工行转债	23,000	2,254,000.00	0.23
6	600775	南京高科	110,000	822,800.00	0.08

5.9 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股指期货投资明细

序号	股票代码	股票
----	------	----