兴全社会责任股票型证券投资基金

【2010】年度报告摘要

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月28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。

本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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全社会责任股票
基金主代码	340007
交易代码	340007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,541,749,240.35份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,将定性与定量研究相结合,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。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业的基础上,采用"兴全双层行业筛选法"进行优化调整。采用"兴全社会责任四维选股模型"精选股票。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数
风险收益特征	较高风险、较高收益

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐天舒	尹东
	联系电话	021-58368998	010-67595003
	电子邮箱	xuts@xyfunds.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099,021-38824536	010-67595096
传真		021-58368858	010-66275853

注:本基金管理人于2011年3月9日公告,自2011年3月5日起,原公司督察长杜建新离任,由公司副总经理徐天舒代行督察长职务。

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xyfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010年	2009年	2008年4月30日(基金合同生效日)至2008年12月31日
本期已实现收益	345,884,322.80	1,250,113,466.03	-215,816,919.20
本期利润	522,066,761.97	2,278,435,459.31	-311,106,325.85
加权平均基金份额本期利润	0.0962	0.7670	-0.2537
本期基金份额净值增长率	6.60%	108.57%	-22.20%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配利润	407,879,682.21	72,207,237.58	-252,774,263.51
期末基金资产净值	6,895,546,306.78	6,914,729,081.76	884,956,982.34
期末基金份额净值	1.518	1.424	0.778

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
过去三个月	7.66%	1.47%	5.24%	1.39%	2.42%	0.08%
过去六个月	25.04%	1.30%	17.89%	1.22%	7.15%	0.08%
过去一年	6.60%	1.31%	-8.03%	1.25%	14.63%	0.06%
过去三年	72.98%	1.47%	-8.22%	1.74%	81.20%	-0.27%
自基金合同生效起至今	72.98%	1.47%	-8.22%	1.74%	81.20%	-0.27%

注:本基金业绩比较基准为80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数,在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:中信标普300指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。中信标普300指数选择中国A股市场中市值规模最大、流动性强和基本因素良好的300家上市公司作为样本股,充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势,是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

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:

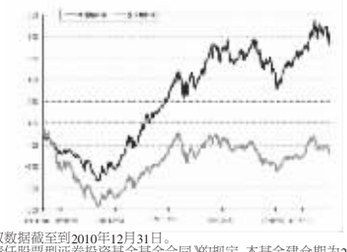
Return_t =80%×(中信标普300指数t / 中信标普300指数t-1 -1) +20%×(中信国债指数t / 中信国债指数t-1 -1)

Benchmark_t =(1+Return_t)×Benchmark_t-1

其中,t=1,2,3,… 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

兴全社会责任股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2008年4月30日至2010年12月31日)

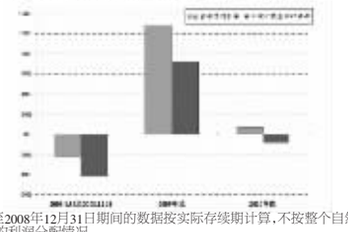


注:1、净值表现所取数据截至到2010年12月31日。

2、按照《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2008年4月30日至2008年10月29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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全社会责任股票型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较图



注:2008年4月30日至2008年12月31日期间的数据按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	-
2009年	1.900	417,923,725.86	353,510,407.53	771,434,133.39	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	1.900	417,923,725.86	353,510,407.53	771,434,133.39	-

§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是经中国证监会《证监基字[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"。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。

截止2010年12月31日,公司旗下管理着九只基金,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)。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
傅鹏博	基金管理部副总监、本基金基金经理	2009-01-16	-	8年	1962年生,经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师,申银万国证券股份有限公司企业融资部经理,东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师;汇添富基金管理有限公司首席策略师。

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"按照中国证券业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定计算。

4.2 管理人对报告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、《兴全社会责任股票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,本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。

4.3.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,兴全全球视野股票和兴全社会责任股票的累计净值增长率分别为3.97%和6.60%,两基金的业绩表现差异未超过5%。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 管理人对报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内本基金投资策略和运作分析

2010年的A股市场,先抑后扬,沪综指全年下跌-14.31%,在全球股票指数涨幅排名中列倒数第三。与此同时,国内资本市场股票市值增至26.43万亿元,跃居全球第三。筹备多年的股指期货于2010年4月16日正式挂牌,首批4个合约当天开始交易;创业板在2010年新增上市公司117家,融资963亿元,公司总数已达153家。大宗商品市场迭创新高,从金价创历史新高伴随着铜、铝等大宗商品的凌厉上涨,再到棉价创历史新高。

2010年,美国、欧洲和日本仍然在经历危机。美国失业率水平仍然保持在历史的高位,超过9%,美联储别无选择地出台了第二轮量化宽松的刺激政策,美国财政赤字和公共债务水平持续攀升。欧洲也同样如此,希腊债务危机揭开了"欧猪五国"的债务黑洞,欧盟有20个国家存在债务压力。日本的债务水平更是占到GDP比重的近200%。

在经济全球化的今天,中国自然难以独善其身,虎年中国面临的政治经济形势是极为复杂与困难的。国内通胀预期加重,地方政府贷款平台的清理整顿,货币持续紧缩,2010年A股市场的震荡和下跌自然难免。2009年中国经济能迅速扭转增速下滑势头,主要得益于一揽子经济刺激计划。其中,政府主导的投资快速扩张发挥了关键作用。2010年,中国经济逐渐步入恢复性增长阶段,经济总量的增速在高位回调有内在要求,也受到政策主动调整的影响。自2010年三季度后政策刺激的短期效应消失殆尽,外生性增长就此结束。10月,当局高决策层在保增长与调结构两者间达成共识时,内生性增长已然开始。四季度开始,政府主导的投资增长逐步下降,国内经济的内需增长动力从政策推动转向市场驱动。出口恢复快速增长,显示我国经济运行已成功摆脱国际金融危机的负面冲击。房地产投资增幅的下降,将带动整体投资增长出现一定幅度回落。

尽管2010年A股市场总体处于下跌通道中,但是市场的结构性机会是明显的,各行业公司的股价表现大相径庭。总体而言,新兴产业、消费类的行业和个股表现良好,而传统行业则跌幅居前。2010年,我们对传统周期性行业比较谨慎,仅在有明显趋势的情况下才适当参与。在经济转型复苏期,非周期性品种能够更加稳定地受益于经济的长期增长。对此,一方面,我们目下而上积极发掘优秀的公司进行配置;另一方面,从板块角度,提高对受益于政策扶持方向以及居民消费升级的医药生物、信息技术、食品饮料、化工等行业的配置比例。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本年度累计净值增长率为6.60%,同期业绩比较基准收益率为-8.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从国际经济环境来看,在财政刺激和货币宽松的影响下,2011年美国经济增速有望达到潜在增长率3%的水平,同时基准利率将维持在低位。全球经济缓慢复苏,美欧就业压力仍然存在,全球再平衡中亚洲货币升值压力增加,可以预见贸易摩擦也将不断出现。同时,我们看到,09年以来中国货币供应量持续偏高,加上全球大宗商品价格上升带来的输入性通胀压力,2011上半年控制通胀将成为我国宏观政策的重要任务。

2011是"十二五规划"的元年,是中国改府换届之年,如果说2009年是最困难的,2010年是最复杂的,那么2011年将是多变的。但是,无论经济复苏的进程如何曲折,我们不能忽视经济向好的方向是确定的。短期来看,通货膨胀压力不容忽视,政策面必然要求控制货币增速,宽松的货币环境或将终结。另一方面,"十二五"规划的开局之年,财政政策仍将积极,其重点在于促进民众消费能力的提高,为此,管理层已经开始采取包括提升工资福利水平、改革分配体系、优化税收结构在内的诸多措施。中长期来看,我们面临着投资、出口与消费之间的失衡调整,未来国家将加大力度进行国民收入分配制度改革,和理顺国内资源价格体系,以拉动内需。

从流动性来看,在美日欧等发达经济体普遍采取扩张性货币政策的情况下,我国控制货币增速,从一定程度上将对冲过剩的流动性,从而短期对市场形成一定的冲击。但是,高通胀持续负利率,催生了货币活化和人民币升值两大背景,支持流动性的相对宽裕,加之国内经济逐步见底回升,股市上行的基础依然存在。

从投资机会来看,2011年可能仍以自下而上的机会为特征,同时辅以行业轮动。从长期配置角度看,可继续关注成长类个股的机会,TMT领域处于其产业周期的上升期,建筑建材、机械、化工等行业受益于经济复苏,都易于有贯穿全年的成长股;消费类个股也不容错过,调结构,促民生的政策背景下,食品饮料、医药生物等行业仍然保有着巨大的机会;全球市场流动性充裕,大宗商品价格将持续高企,可适时把握资源类和低估值周期性行业的机会,如煤炭、有色、农业和地产、水泥等行业的阶段性表现;低估值的蓝筹股亦有阶段性表现的机会。

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给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》、《兴全社会责任股票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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2011)审字第60467611_B05号
备注	投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:兴全社会责任股票型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产:			
银行存款		1,070,019,651.43	647,611,597.52
结算备付金		17,347,044.48	19,994,948.45
存出保证金		4,756,515.64	4,828,412.89
交易性金融资产		6,062,563,879.38	6,142,601,111.39
其中:股票投资		6,062,563,879.38	6,142,601,111.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		123,299,357.53	109,838,704.49
应收利息		156,954.92	133,812.47
应收股利		-	-
应收申购款		8,613,902.32	36,755,883.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,286,757,305.70	6,961,764,470.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
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		-	10,729,066.14
应付赎回款		368,862,531.26	19,749,274.52
应付管理人报酬		9,309,912.39	8,261,048.53
应付托管费		1,551,652.07	1,376,841.39
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		9,935,918.99	6,275,431.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,550,984.21	643,726.63
负债合计		391,210,998.92	47,035,388.45
所有者权益:			
实收基金		4,541,749,240.35	4,855,541,167.61
未分配利润		2,353,797,066.43	2,059,187,914.15
所有者权益合计		6,895,546,306.78	6,914,729,081.76
负债和所有者权益总计		7,286,757,305.70	6,961,764,470.21

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.518元,基金份额总额4,541,749,240.35份。

7.2 利润表

会计主体:兴全社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		707,637,394.82	2,387,967,950.32
1.利息收入		7,813,648.14	8,114,672.89
其中:存款利息收入		7,291,994.65	2,999,309.25
债券利息收入		1,674.90	5,115,363.64
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		519,978.59	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		519,632,927.05	1,347,678,025.26
其中:股票投资收益		472,400,943.74	1,309,121,998.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,535,206.70	14,842,253.96
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	570,699.59
股利收益		45,696,776.61	23,143,073.64
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		176,182,439.17	1,028,321,993.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		4,008,380.46	3,853,258.89
减:二、费用		185,570,632.85	109,532,491.01
1.管理人报酬		112,910,431.07	56,685,235.48
2.托管费		18,818,405.33	9,447,539.21
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		53,393,967.62	42,815,852.46
5.利息支出		-	169,073.20
其中:卖出回购金融资产支出		-	169,073.20
6.其他费用		447,828.83	414,790.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		522,066,761.97	2,278,435,459.31
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		522,066,761.97	2,278,435,459.31

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	4,855,541,167.61	2,059,187,914.15	6,914,729,081.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	522,066,761.97	522,066,761.97
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)	-313,791,927.26	-227,457,609.69	-541,249,536.95
其中:1.基金申购款	2,461,554,051.90	947,316,476.15	3,408,870,528.05
2.基金赎回款	-2,775,345,979.16	-1,174,774,085.84	-3,950,120,065.00
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)	4,541,749,240.35	2,353,797,066.43	6,895,546,306.78
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	1,137,731,245.85	-252,774,263.51	884,956,982.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,278,435,459.31	2,278,435,459.31
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)	3,717,809,921.76	804,960,851.74	4,522,770,773.50
其中:1.基金申购款	6,280,696,840.60	1,450,765,104.28	7,731,461,944.88
2.基金赎回款	-2,562,886,918.84	-645,804,252.54	-3,208,691,171.38
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)	-	-771,434,133.39	-771,434,133.39
五、期末所有者权益(基金净值)	4,855,541,167.61	2,059,187,914.15	6,914,729,081.76

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:兰荣,主管会计工作负责人:杨东,会计机构负责人:詹鸿飞

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

兴全社会责任股票型证券投资基金(原名兴业社会责任股票型证券投资基金)(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]356号文《关于核准兴业社会责任股票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发起人向社会公开发行募集,基金合同于2008年4月30日正式生效,首次设立募集规模为1,388,696,479.84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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。兴业社会责任股票型证券投资基金于2011年1月1日更名为兴全社会责任股票型证券投资基金。

本基金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、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。本基金为股票型基金,各类资产的投资比例为:股票投资比例为65%-95%;债券投资比例为0%-30%;资产支持证券占0%-20%;权证投资比例0%-3%;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%。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。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的80%。

业绩比较基准为:80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数。

7.4.2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>估值业务及会计核算有关事项的通知》、《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。

7.4.3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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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相一致的说明

本基金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。

7.4.5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。

7.4.6 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司 (以下简称"建设银行")	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
全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V)	基金管理人股东

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。

7.4.7本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	8,883,769,311.61	25.59%	10,125,881,117.49	34.81%

7.4.7.1.2权证交易

本基金2010年年度及2009年年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.7.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
兴业证券	0.00	0.00%	73,057,718.77	62.19%

7.4.7.1.4债券回购交易

本基金2010年年度及2009年年度均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.7.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比重	期末应付佣金余额	期末应付佣金总量的比重
兴业证券	7,308,571.93	25.20%	811,881.97	3.17%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比重	期末应付佣金余额	期末应付佣金总量的比重
兴业证券	8,301,691.37	31.07%	660,289.27	10.53%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.7.2关联方报酬

7.4.7.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	112,910,431.07	56,685,235.48
其中:支付销售机构的客户维护费	16,331,706.68	5,440,108.28

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:每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.7.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	18,818,405.33	9,447,539.21

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。

7.4.7.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日			
债券回购交易的金额	债券交易金额		债券回购	
期末余额	买入	卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
债券回购交易的金额	债券交易金额		债券回购	
期末余额	买入	卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	185,000,000.00	23,213.08

7.4.7.4各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	37,304,663.21	37,304,663.21
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	-	-
期末持有的基金份额	37,304,663.21	37,304,663.21
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.82%	0.77%

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