

兴全合润分级股票型证券投资基金

[2011] 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:二〇一一年四月二十二日重要提示
基金管理人的董事会及董事声明本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。基金管理人拓扑投资有限公司根据本基金合同规定，于2011年4月18日复核了本基金的财务状况、净值表现和投资组合报告内容，确认报告的内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，本基金不存在违法、违规行为，且复核结果表明不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。基金管理人保证过往业绩并不代表其未来表现。投资风险，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。本报告的财务资料未经审计。

本基金日期2011年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:兴全合润分级股票

基金主代码:163406

基金运作方式:契约型上市开放式

基金合同生效日:2010年4月22日

报告期末基金份额总额:1,820,306,050.08份

投资目标:本基金通过定期与定性相结合精选股票，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。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资收益率等市场指标，确定未来市场趋势。本基金通过定期评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。

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，基金资产整体的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

下属三级基金的基金简称:兴全合润分级股票

兴全合润A

兴全合润B

兴全合润150001

兴全合润150017

报告期末下属三级基金的份额:1,533,668,219.08份

114,655,136份

171,982,704份

总份额:1,533,668,219.08份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币

主要财务指标 报告期(2011年1月1日-2011年3月31日)

1.本期已实现收益 15,284,353.61

2.本期利润 -37,482,821.95

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0181

4.期末基金份额净值 1,932,226,235.88

5.期末基金资产净值 1,0615

注:1.本公司现收取基金管理费本周期期初收入、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，本周期期初收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)等费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等)计入本期净实现收益并平摊至所有列示列数。

3.2 基金份额净值表现及其与同期业绩比较基准的差异比较

3.2.1 本期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准的差异比较

3.2.2 本基金因生息以来至报告期末的基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的比较

兴全合润分级股票基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的比较

兴全合润分级股票基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的比较

2010年4月22日至2011年3月31日

注:1.净值增长率数据截至到2011年3月31日。

2.本基金因生息以来至报告期末的基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.本基金成立2010年4月22日,截至2011年3月31日,本基金成立不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理/基金经理助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

张惠萍 本基金基金经理 2010-4-22 - 8年 1976年生，兴业基金管理有限公司(筹)，历任兴业基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金、兴全回报基金管理有限公司基金经理。

5.7 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产投资明细

5.8 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

5.9 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

5.10 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资明细

5.11 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置情况

5.12 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.13 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.14 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.15 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.16 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.17 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.18 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.19 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.20 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.21 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.22 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.23 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.24 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.25 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.26 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.27 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.28 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.29 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.30 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.31 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.32 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.33 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.34 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.35 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.36 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.37 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.38 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.39 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.40 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.41 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.42 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.43 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.44 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.45 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.46 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.47 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.48 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.49 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.50 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.51 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.52 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.53 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.54 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.55 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.56 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.57 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.58 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.59 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.60 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.61 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.62 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.63 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.64 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.65 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.66 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.67 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.68 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.69 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.70 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.71 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.72 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.73 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.74 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.75 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.76 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.77 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.78 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.79 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.80 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.81 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.82 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.83 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.84 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.85 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.86 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.87 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.88 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.89 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.90 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.91 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.92 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.93 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.94 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.95 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名资产配置组合

5.96 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资组合

5.97 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

5.98 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产净值比例大小排名的前五名权证及金融衍生品投资组合

5.99 历任基金经理在本基金任职期间的基金资产