

信息披露 Disclosure

兴全社会责任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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年四月二十二日

\$1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本基金报告期内不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质真实性、准确性完整性承担责任。基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2011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，但不保证投资于本基金一定盈利。本基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自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
报告期末基金份额总额	6,468,514,117.36份
投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值，同时强调上市公司的持续发展、法律、道德责任方面的履行。
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，将定量研究相结合，在宏观及微观层面对于各类资产的价值增长能力展开评估，动态优化资产配置。在根据行业所处生命周期、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%×中投标普国债指数
风险收益特征	较高风险、较高收益
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
\$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(2011年1月1日-2011年3月31日)
1.本期已实现收益	114,480,223.69
2.本期利润	-480,815,622.66
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1002
4.期末基金份额净值	6,551,555,374.32
5.期末基金份额净值	1.409

注:1.本基金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.上述基金业业绩指标不包括持有人认购或申购基金所产生的费用(例如：申购赎回费、红利再投资、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 率净值增长 率业绩比较基 准收益率差额①② 业绩比较基 准收益率③④

过去三个月 -7.18% 1.19% 2.09% 1.08% -9.27% 0.11%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比

兴全社会责任股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势图

2008年4月30日至2011年3月31日



注:1.净值表现所取数据截至到2011年3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。

3.4 管理人报告

4.1 基金经理(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
傅鹏博	本基金基金经理副 总监、本基金基 金经理	2009-1-16	-	1962年生，经济学硕士，历任上海财经大学经济系讲师，申银万国证券股份有限公司金融市场部经理，东方证券投资基金管理有限公司资产管理部研究员、研究部首席策略师；汇添富基金管理有限公司首席策略师。

注:1.本基金在任职期间内无任何尚未支付的薪酬或因个人原因辞职、被辞退或解聘的情况。

2.任本基金基金经理之日即2011年1月16日，基金成立即担任基金经理本公司已作出聘任决定之日起，基金成立后基金经理在任职期间内未按公司有关规定支付薪酬。

3.2010年1月16日，基金成立即担任基金经理本公司已作出聘任决定之日起，基金成立后基金经理在任职期间内未按公司有关规定支付薪酬。

4.2 财务报告对报告期内本基金运作遵规守法情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格依照《证券投资基金法》及其各项实施细则，遵循社会公众基金份额持有人利益优先的原则，勤勉尽责，诚信取信于投资人，致力于维护基金份额持有人的合法权益，严格按照基金合同的规定，依法合规运作，未损害基金份额持有人的利益。

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，本基金基金经理严格按照《公平交易制度》，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做到公平对待，保护基金份额持有人的利益。

4.3.2 不同投资组合之间公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，严格执行《公平交易制度》，并定期对不同投资组合之间的交易行为进行评估，评估结果表明，本基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均不存在不公平交易和利益输送的情况。

4.4 投资组合的异常交易行为的专项说明

本基金报告期内，严格执行《公平交易制度》，并定期对不同投资组合之间的交易行为进行评估，评估结果表明，本基金在投资决策、交易执行、业绩评估等环节均不存在不公平交易和利益输送的情况。

4.5 报告期内基金投资组合类别的前十大重仓股明细

本基金报告期内，兴全社会责任股票型基金的前十大重仓股分别为0.28%和-7.18%，两项的净值得表现均超过了5%，引起这一差距的主要原因如下：

1.行业配置的差异：兴全社会责任股票型基金的行业配置相对均衡，整体行业配置较为分散，而本基金的行业配置风格相对集中，集中在金融、食品饮料、房地产、综合等行业，行业配置的差异导致了行业的配置差异。

2.个股选择的差异：兴全社会责任股票型基金的个股选择风格相对保守，而本基金的个股选择风格相对激进，买入持有时间较短，从而导致了个股的配置差异。

3.操作风格的差异：兴全社会责任股票型基金的操作风格相对稳健，而本基金的操作风格相对激进，从而导致了操作风格的差异。

4.估值方法的差异：兴全社会责任股票型基金的估值方法相对保守，而本基金的估值方法相对激进，从而导致了估值方法的差异。

5.持仓结构的差异：兴全社会责任股票型基金的持仓结构相对均衡，而本基金的持仓结构相对集中，从而导致了持仓结构的差异。

6.投资策略的差异：兴全社会责任股票型基金的投资策略相对保守，而本基金的投资策略相对激进，从而导致了投资策略的差异。

7.风险管理的差异：兴全社会责任股票型基金的风险管理相对保守，而本基金的风险管理相对激进，从而导致了风险管理的差异。

8.流动性管理的差异：兴全社会责任股票型基金的流动性管理相对保守，而本基金的流动性管理相对激进，从而导致了流动性管理的差异。

9.其他差异：兴全社会责任股票型基金的其他方面差异，从而导致了其他方面的差异。

10.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.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未超出基金合同规定的备选股票库。

12.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

13.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

14.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

15.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

16.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

17.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

18.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

19.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

20.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

21.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

22.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

23.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

24.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

25.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

26.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

27.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

28.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

29.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

30.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

31.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

32.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

33.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

34.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

35.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

36.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

37.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

38.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

39.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

40.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

41.报告期末前十名股票中存在限售情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

42.报告期末持有的处于转股期的可转换债券情况

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。