兴全货币市场证券投资基金

【2012】第二季度报告

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:２０１２年７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2012年7月17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2012年4月1日起至6月30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	984,314,027.98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(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1. 本期已实现收益	8,780,319.39
2.本期利润	8,780,319.39
3.期末基金资产净值	984,314,027.98

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	1.0002%	0.0029%	0.8070%	0.0003%	0.1932%	0.0026%

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2012年6月30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	本基金和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理	2012年6月29日	-	7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。
李友超	-	2007年4月17日	2012年6月29日	-	-

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,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

报告期内,海外经济环境出现动荡,欧债问题再度引发金融市场避险情绪上升,欧洲各国间的债务博弈问题短期难以解决,二季度表现为希腊选举问题和西班牙银行业问题,欧元表现弱势,欧洲经济下滑趋势依然确定;美国经济增长虽然较为缓慢,但QE3概率实质上并不高,美元保持强势而大宗商品价格回落;国内保增长政策陆续出台,但效果低于预期,经济进一步下滑,CPI继续回落,央行于5月下调存款准备金率25bp,6月进行非对称降息一次。

二季度资金面前松后紧,R007一度回落到2.5%以下,Shibor各期限品种收益率也有比较大的降幅,不过临近半年末考核时资金面重新紧张,央行采取了逆回购的方式进行对冲。债券市场总体上涨,受准备金率下调及降息的影响,货币基金参与品种中短融收益率大幅下行,货币基金整个行业收益率也保持较高收益。二季度,我们保持相对稳定的协议存款和短融组合,实现组合收益和流动性的适度搭配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为1.0002%,同期业绩比较基准收益率为0.8070%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年第三季度,通胀继续保持低位的悬念不大,不排除部分月份CPI回落到2%以下,经济基本面上无论国内还是海外的问题都需要更长的时间来消化,国内经济寻底——预期放松和实质放松交替——确认是否底部的过程尚未结束,债券资产仍有配置价值,但收益率下行幅度最大的阶段估计已经过去,可能呈现缓慢下行的走势。政策层面上降息和降准仍有空间,预计未来一个季度资金面保持适度宽松,资金利率不会很高,短期债券品种仍有持有价值。

§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	固定收益投资	260,146,108.15	26.10
	其中:债券	260,146,108.15	26.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	20,000,000.00	2.01
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	696,972,460.93	69.93
4	其他资产	19,496,377.09	1.96
5	合计	996,614,946.17	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.11	
	其中:买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	9,599,865.60	0.98
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	124
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	87

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	11.88	0.98
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	37.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.02	-
3	60天(含)-90天	11.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	24.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	14.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.27	0.98

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	49,268,810.86	5.01
3	金融债券	10,080,880.36	1.02
	其中:政策性金融债	10,080,880.36	1.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,796,416.93	20.40
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	260,146,108.15	26.43
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	10,080,880.36	1.02

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	1101096	11央行票据96	500,000	49,268,810.86	5.01
2	011104003	11中石集SCP003	400,000	40,064,004.55	4.07
3	041259025	12蓝天CP001	200,000	20,164,575.00	2.05
4	041255013	12大众CP001	200,000	20,004,759.41	2.03
5	041256003	12赣高速CP001	200,000	20,000,416.07	2.03
6	041259032	12川交投CP001	200,000	19,983,687.38	2.03
7	041259011	12浙国贸CP001	100,000	10,187,267.59	1.03
8	041159003	11北电CP001	100,000	10,159,198.55	1.03
9	041259004	12闽能源CP001	100,000	10,115,321.51	1.03
10	041161007	11中电投CP005	100,000	10,110,825.09	1.03

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	0.1852%
报告期内偏离度的最低值	0.0466%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1035%

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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,即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	9,133,186.87
4	应收申购款	10,363,190.22
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	19,496,377.09

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§６ 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	847,272,497.46
本报告期基金总申购份额	1,201,888,553.05
减:本报告期基金总赎回份额	1,064,847,022.53
本报告期期末基金份额总额	984,314,027.98

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 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§８ 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 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
２０１２年７月１９日

兴全可转债混合型证券投资基金

【2012】第二季度报告

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:２０１２年７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2012年7月17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2012年4月1日起至6月30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	3,880,909,652.70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股票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,选择所处行业发展前景良好、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(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	-8,818,360.63
2.本期利润	83,097,207.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0211
4.期末基金资产净值	4,082,051,798.36
5.期末基金份额净值	1.0518

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。

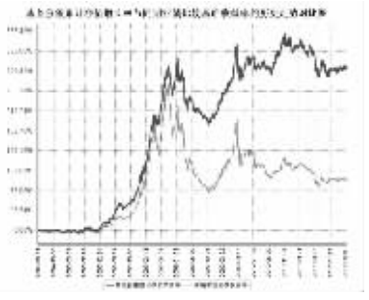
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.01%	0.43%	1.48%	0.38%	0.53%	0.05%

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2012年6月30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	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	-	10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

报告期内,海外经济环境出现动荡,欧债问题再度引发金融市场避险情绪上升,欧洲各国间的债务博弈问题短期难以解决,二季度表现为希腊选举问题和西班牙银行业问题,欧元表现弱势,欧洲经济下滑趋势依然确定;美国经济增长虽然较为缓慢,但QE3概率实质上并不高,美元保持强势而大宗商品价格回落;国内保增长政策陆续出台,但效果低于预期,经济进一步下滑,CPI继续回落,央行于5月下调存款准备金率25bp,6月进行非对称降息一次。

二季度资金面前松后紧,R007一度回落到2.5%以下,Shibor各期限品种收益率也有比较大的降幅,不过临近半年末考核时资金面重新紧张,央行采取了逆回购的方式进行对冲。债券市场总体上涨,受准备金率下调及降息的影响,货币基金参与品种中短融收益率大幅下行,货币基金整个行业收益率也保持较高收益。二季度,我们保持相对稳定的协议存款和短融组合,实现组合收益和流动性的适度搭配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为1.48 %。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

逐步趋于宽松的货币政策环境是我们现在已经看到了,在二季度初基于实体经济层面的快速下滑,市场对后续宽松的货币政策和积极的财政政策都充满了期待,而后续我们可以看到在财政政策上明显较为谨慎,更注重在调结构上。从前5个月的数据来看,投资仍然保持在20%以上的较高水平,而很多周期性行业似乎就进入了寒冬,说明周期性行业的产能过剩是比较严峻的,从理性的角度也很难再让政策推动新的一轮投资扩张来维持部分行业的产能,否则我们只会越走越远。在这个阶段将将很难有保增长的财政政策可期待,看长一点对中国经济可能是好事情。因此在投资上应当关注未来经济结构调整的机会。

央行在一个月内的两次非对称降息说明6月份的实体经济数据仍然较差,如果此轮经济下滑没有相应的财政政策配套,那么后续降息的空间可能仍存在,因此仍需要关注固定收益市场的机会,虽然经过今年以来的上涨后,固定收益债券的收益空间已明显收窄,但风险毕竟仍较小。可转债目前除了大市值的转债外,其余中小市值的转债整体已不便宜,至少预期了很高的股票市场机会。如果在三季度股市都没有很好的表现,目前的转债估值可能难以支持,但整体风险与过去几年比较也并不大。

§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	800,691,737.65	19.57
	其中:股票	800,691,737.65	19.57
2	固定收益投资	2,793,990,712.93	68.28
	其中:债券	2,793,990,712.93	68.28
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	211,900,000.00	5.18
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	77,468,250.47	1.89
6	其他资产	207,750,290.99	5.08
7	合计	4,091,800,992.04	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	采掘业	38,800,000.00	0.95
C	制造业	372,425,598.67	9.12
C0	食品、饮料	71,732,990.16	1.76
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	120,695,412.39	2.96
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	47,254,483.06	1.16
C7	机械、设备、仪表	78,187,293.21	1.92
C8	医药、生物制品	54,555,419.85	1.34
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,630,000.00	0.16
E	建筑业	13,110,000.00	0.32
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	360,177,970.08	8.82
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	9,548,168.90	0.23
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	800,691,737.65	19.61

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	601318	中国平安	4,550,002	208,117,091.48	5.10
2	600143	金发科技	20,216,987	120,695,412.39	2.96
3	000776	广发证券	3,344,000	98,146,400.00	2.40
4	601601	中国太保	2,430,770	53,914,478.60	1.32
5	601633	长城汽车	2,626,910	46,758,998.00	1.15
6	002353	杰瑞股份	800,000	38,800,000.00	0.95
7	600529	山东药玻	3,954,071	37,405,511.66	0.92
8	600750	江中药业	1,067,289	29,788,035.99	0.73
9	600195	中牧股份	1,451,781	24,767,383.86	0.61
10	000895	双汇发展	400,000	24,752,000.00	0.61

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	-	-
2	央行票据	184,179,000.00	4.51
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	119,406,741.10	2.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,490,404,971.83	61.01
8	其他	-	-
9	合计	2,793,990,712.93	68.45

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110015	石化转债	7,877,200	787,011,052.00	19.28
2	113001	中行转债	4,382,820	425,659,478.40	10.43
3	110017	中海转债	2,383,230	232,674,744.90	5.70
4	110013	国投转债	1,740,310	187,013,712.60	4.58
5	110016	川投转债	1,674,520	173,882,156.80	4.26

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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,并且未在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,015,422.29
2	应收证券清算款	176,514,313.33
3	应收股利	-
4	应收利息	16,922,859.19
5	应收申购款	13,297,696.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,750,290.99

5.8.4 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	787,011,052.00	19.28
2	113001	中行转债	425,659,478.40	10.43
3	110017	中海转债	232,674,744.90	5.70
4	110013	国投转债	187,013,712.60	4.58
5	110016	川投转债	173,882,156.80	4.26
6	110011	歌华转债	141,809,998.20	3.47
7	110018	国电转债	101,624,517.90	2.49
8	110003	新钢转债	99,096,439.90	2.43
9	110007	博汇转债	82,297,080.00	2.02
10	125089	深机转债	74,442,811.06	1.82
11	110012	海运转债	66,714,795.00	1.63
12	125731	美丰转债	40,414,776.18	0.99
13	129031	巨轮转2	34,575,391.14	0.85
14	125887	中期转债	2,629,241.75	0.06

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000776	广发证券	98,146,400.00	2.40	非公开发行

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§６ 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,992,562,200.38
本报告期基金总申购份额	49,372,557.12
减:本报告期基金总赎回份额	161,025,104.80
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,880,909,652.70

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 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§８ 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

8.3 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
２０１２年７月１９日

兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)

【2012】第二季度报告

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:２０１２年７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2012年7月17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2012年4月1日起至6月30日止。

§２ 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资股票(LOF)
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	1,479,061,433.64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(2012年4月1日 - 2012年6月30日)
1.本期已实现收益	10,156,053.01
2.本期利润	29,105,884.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0194
4.期末基金资产净值	1,364,743,437.75
5.期末基金份额净值	0.923

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。

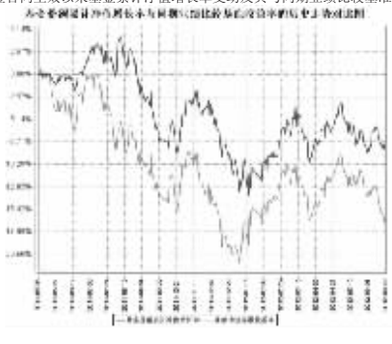
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	2.10%	0.80%	0.71%	0.89%	1.39%	-0.09%

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2012年6月30日。

2、按照《兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2011年5月6日至2011年8月5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		
傅鹏博	基金管理部副总监、本基金和兴全社会责任股票型证券投资