

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

[2012]第四季度报告

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:2013年1月22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2013年1月18日复核了本报表中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，确认复核结果无虚假记载、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10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:兴全有机增长混合

基金主代码:340008

交易代码:340008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同期效日:2009年3月25日

报告期末基金份额总额:1,485,013,391.43份

本基金主要投资于有持续成长能力的公司，获取当前收益及实现长期资本增值。

本基金采取“自下而上”的方法，定性+定量做研究相结合。

本基金在行业、主题、风格等资产类别之间进行资产配置，在宏观、微观层面分别对各类资产的价格成长能力进行综合评估，动态化地调整资产配置，并借鉴海外市场增长的研究经验，构建“兴业有机增长筛选系统”，将有机增长投资作为本基金股票投资的核心理念。

中信标普300指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%

本基金是混合型券基投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型证券投资基金，高于可转债、债券型货币型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的证券投资基金。

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司

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

报告期(2012年10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -52,074,339.48

2.本期利润 62,576,018.32

3.加权平均基金份额本期利润 0.0412

4.期末基金份额净值 1,611,692,865.48

5.期末基金份额净值 1,085.3

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费用，例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等，计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3.2.1 本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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 4.14% 1.04% 5.18% 0.62% -1.04% 0.42%

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

图:兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同的规定，本基金建仓期为2009年3月25日至2009年1月25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

陈晓帆 本基金和兴全轻资产投资基金型证券投资基金(LOF)基金经理 2009年3月25日 - 11年

注:1.任职指截至报告期末的职务，报告期末仍在任的)或离任前的职务，报告期仍在任的)。

2.任职日期指公司作出聘任决定之日，离任日期指公司作出解聘决定之日。

3.能从任职时间上识别其从事证券研究、投资、交易等工作的年限。

4.2.2 本基金基金经理的任职情况说明

本基金基金经理个人严谨审慎，遵守基金法及其各项实施细则，严格按照法律法规的规定履行基金的管理职责，基金合同及其他相关法律、法规的约定，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，基金管理人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者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，基金管理人严格按照《证券投资基金管理法》、《证券投资基金管理办法》公平交易制度指

导意见书以及公司制度的规定，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，考察是否存在不公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 报告期内本基金投资组合和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。

4.4.2 报告期内基金管理人执行公平交易制度的专项说明

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.6 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.7 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.8 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.9 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.10 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.11 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.12 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.13 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.14 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.15 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.16 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.17 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.18 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.19 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.20 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.21 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.22 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.23 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.24 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.25 公平交易制度的执行情况

本基金持仓以成长股为主，安防、园林、消费品是我们配置的主要行业。10月净值表现尚可，我们判断后市还会以市场一致预期的一轮暴跌，相反会考虑上涨的可能性。今后走势虽然在大方向上合乎我们的预测，但股市下跌了两周，而上涨的是小市值板块和成长股，由于结构的原因，相信对于市场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，基金管理人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者损害基金份额持有人利益的行为。

4.26 公平交易制度的执行情况