

兴全磐稳增利债券型证券投资基金

[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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2013年1月22日

§ 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。

基金托管人交通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。投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期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

本基金简称:兴全磐稳增利债券

基金主代码:340009

交易代码:340009

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2009年7月23日

报告期末基金份额总额:136,171,137.23份

投资目标:本基金在保证基金资产良好流动性的基础上，通过严格风险控制下的债券及债券产品投资，追求低风险下的稳定收益，并争取在基金资产保值增值的基础上，积极利用各种稳健的金融工具与资产的持续增值。

投资策略:在严格的风控和确保基金资产流动性的前提下，在系统性分析研究的基础上，通过对债券类属配置和目标久期的适时调整，适时合理地利用现有的债券类投资工具，配合套利策略的积极运用，追求低风险下的稳健收益。

业绩比较基准:中信标普全债指数×95%+同业存款利率×5%

风险收益特征:本基金是债券型证券投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型、混合型以及可转换证券投资基金，高于货币市场基金。

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

§ 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10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 817,415.03

2.本期利润 1,046,100.20

3.加权平均基金份额本期利润 0.0076

4.期末基金份额净值 137,677,426.13

5.期末基金份额净值 1.0111

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、基金转换等，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 收益率标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 0.76% 0.06% 0.98% 0.02% -0.22% 0.04%

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:兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同规定的比例限制及投资组合的范围。

§ 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 任职日期 离任日期 说明

张睿 本基金及兴全货币市场证券投资基金基金经理 2012年4月27日 - 7年 1981年生，经济学硕士，历任红顶金融助理研究员、研究中心高级分析师，兴全基金管理有限公司研究员。

注:1.职务指截止报告期末的职务，报告期末仍在的(或离任前的)报告期截至离任日期。

2.任职日期指基金成立之日，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.任职从业年限，按其从事证券期货、研究等工作年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，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、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度的规定，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，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司不断完善内部控制机制，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5%的情况，未发现可能涉及不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金管理人投资策略业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度的规定，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，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司不断完善内部控制机制，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。

4.4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的专项说明

本基金报告期内，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5%的情况，未发现可能涉及不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.6 报告期内基金管理人投资策略和业绩表现说明

4.6.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度的规定，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，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司不断完善内部控制机制，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。

4.6.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3 公平交易专项说明

4.6.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度的规定，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，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司不断完善内部控制机制，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。

4.6.3.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.3 公平交易专项说明

4.6.3.4 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.5 公平交易专项说明

4.6.3.6 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.7 公平交易专项说明

4.6.3.8 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.9 公平交易专项说明

4.6.3.10 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.11 公平交易专项说明

4.6.3.12 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.13 公平交易专项说明

4.6.3.14 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.15 公平交易专项说明

4.6.3.16 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.17 公平交易专项说明

4.6.3.18 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.19 公平交易专项说明

4.6.3.20 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.21 公平交易专项说明

4.6.3.22 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.23 公平交易专项说明

4.6.3.24 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.25 公平交易专项说明

4.6.3.26 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.27 公平交易专项说明

4.6.3.28 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.29 公平交易专项说明

4.6.3.30 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.31 公平交易专项说明

4.6.3.32 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.33 公平交易专项说明

4.6.3.34 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.6.3.35 公平交易专项说明

4.6.3.36 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全趋势投资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，诚实信用、勤勉尽责，取信于市场，取信于社会的公信力原则运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金报告期内，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损害基金份额持有人利益的行为。

4.