

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：2013年1月22日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事、监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。

本基金托管人工商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內容，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本基金，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。

本报告期未向基金份额持有人进行分红。

本报告期1月10日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 兴全绿色投资股票型证券投资基金(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16日

报告期末基金份额总额 1,438,861,731.14份

基金投资目标 本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及在产业链中积极履行社会责任的上市公司，力争实现当期投资收益与长期资本增值。

基金投资策略 本基金在大类资产配置上，采取风险与定量研究相结合，在股票与债券资产类别之间进行资产配置。在宏观及微观层面从对各类资产的价值增长潜力展开综合评估，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基本面因素相结合，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。其预期风险和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

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 -77,503,828.66

2.本期利润 62,904,784.72

3.加权平均基金份额本期利润 0.0435

4.期末基金份额净值 1,315,785,983.58

5.期末基金份额净值 0.914

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.所述基金份额净值不包括持有人认购或交易本基金的各项费用；例如：申购赎回费、红利再投费、基金转换费等，计算公式为收益除以实际收益天数减去若干列数字。

3.2.1 本基金报告期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 4.94% 1.03% 8.13% 1.02% -3.19% 0.01%

3.2.2 基金合同生效以来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

基金净值增长率与业绩比较基准收益率对比图

注：1.净值表现所取数据截至到2012年12月31日。

2.按照《公开募集证券投资基金合同》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如下：

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理助理简介

姓名 职务 在本基金的基金管理期限 证券从业年限 说明

傅鹏博 基金管理部副总监、本基金及兴全社会责任基金经理 2011年5月6日 - 19年 1992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工程部研究员，东方证券股份有限公司资产管理部负责人，现就职于兴业基金管理有限公司首席策略师。

陈锦泉 基金基金经理 2011年5月6日 - 13年 1997年生，经济学硕士，历任华泰证券研究所分析师，平安证券研究所研究员，平安保险资产管理公司核心小组成员，平安资产管理公司公司总经理助理。

注：1.任职指截止报告期末的职务，报告期末仍在任的①或离任前的职务，报告期内离任的②。

2.任本基金基金经理的首次时间指基金成立之日起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；离任指公司作出解聘决定之日。

3.从业年限从任职之日起算，不满一年的，填写1年。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的总体评价

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》公平交易制度指导意见及公司相关制度的规定，从授权投研、研究分析、投资决策、投资执行、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，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。

§ 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 股权投资 897,542,483.08 24.77

2 固定收益投资 897,542,483.08 24.77

3 资产支持证券 - -

4 大宗商品投资 - -

5 衍生工具的买入返售金融资产 100,000,000.00 2.76

6 银行存款和结算备付金合计 72,868,457.12 2.01

7 其他资产 96,138,836.71 2.65

8 合计 1,351,739,563.64 100.00

注：1.净值得表现所取数据截至到2012年12月31日。

2.按照《公开募集证券投资基金合同》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如下：

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额 3,562,798,964.74

报告期期间内申购份数 44,232,201.08

报告期期间内赎回份数 132,151,649.04

报告期末基金份额总额 3,474,879,515.88

注：申购赎回费用由申购人承担，赎回费用由赎回人承担。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 兴全绿色投资股票型证券投资基金 LOF

## [ 2012 ] 第 四 季 度 报 告

2.按照《公开募集证券投资基金合同》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如下：

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理助理简介

姓名 职务 在本基金的基金管理期限 证券从业年限 说明

傅鹏博 基金管理部副总监、本基金及兴全社会责任基金经理 2011年5月6日 - 19年 1992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工程部研究员，东方证券股份有限公司资产管理部负责人，现就职于兴业基金管理有限公司首席策略师。

陈锦泉 基金基金经理 2011年5月6日 - 13年 1997年生，经济学硕士，历任华泰证券研究所分析师，平安证券研究所研究员，平安保险资产管理公司核心小组成员，平安资产管理公司公司总经理助理。

注：1.任职指截止报告期末的职务，报告期末仍在任的①或离任前的职务，报告期内离任的②。

2.任本基金基金经理的首次时间指基金成立之日起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；离任指公司作出解聘决定之日。

3.从业年限从任职之日起算，不满一年的，填写1年。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的总体评价

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》公平交易制度指导意见及公司相关制度的规定，从授权投研、研究分析、投资决策、投资执行、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，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。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林、牧、渔业 - -

2 制造业 1,177,067,059.52 87.08

3 交通运输、仓储和邮政业 120,421,000.00 8.91

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 120,421,000.00 8.91

5 金融、地产 10,000,000.00 0.74

6 其他 27,227,005.45 2.01

7 其他资产 17,024,498.67 1.26

8 合计 1,351,739,563.64 100.00

注：1.净值得表现所取数据截至到2012年12月31日。

2.按照《公开募集证券投资基金合同》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如下：

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额 3,562,798,964.74

报告期期间内申购份数 44,232,201.08

报告期期间内赎回份数 132,151,649.04

报告期末基金份额总额 3,474,879,515.88

注：申购赎回费用由申购人承担，赎回费用由赎回人承担。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## 兴全绿色投资股票型证券投资基金 LOF

## [ 2012 ] 第 四 季 度 报 告

2.按照《公开募集证券投资基金合同》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如下：

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理助理简介

姓名 职务 在本基金的基金管理期限 证券从业年限 说明

傅鹏博 基金管理部副总监、本基金及兴全社会责任基金经理 2011年5月6日 - 19年 1992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工程部研究员，东方证券股份有限公司资产管理部负责人，现就职于兴业基金管理有限公司首席策略师。

陈锦泉 基金基金经理 2011年5月6日 - 13年 1997年生，经济学硕士，历任华泰证券研究所分析师，平安证券研究所研究员，平安保险资产管理公司核心小组成员，平安资产管理公司公司总经理助理。

注：1.任职指截止报告期末的职务，报告期末仍在任的①或离任前的职务，报告期内离任的②。

2.任本基金基金经理的首次时间指基金成立之日起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；离任指公司作出解聘决定之日。

3.从业年限从任职之日起算，不满一年的，填写1年。

4.2 管理人对报告期内本基金运作的总体评价

本报告期内，基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金托管协议》公平交易制度指导意见及公司相关制度的规定，从授权投研、研究分析、投资决策、投资执行、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理本基金，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