

2013年1月22日 星期二

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送达日期：2013年1月22日

§ 1 重要提示
基金管理人的董事局及董事会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，并对其中内容的真性、准确性、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农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。

本报告期无临时公告的重大事件。

本报告期内2012年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 兴全沪深300指数(LOF)

基金主代码 163407

交易代码 163407

前端交易代码 163407

后端交易代码 163408

基金运作方式 上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2010年11月22日

报告期末基金份额总额 1,505,704,912.09份

投资目标 本基金采取指数复制法结合相对增效的投资策略，即通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。本基金力争在跟踪误差不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，年度跟踪差额不超过3.3%的情况下跟踪误差不超过4.75%。

投资策略 本基金采取指数复制法相对增效的投资策略，即通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。本基金将指数成分股的预期收益高于混合基金、债券基金与货币基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币基金。本基金为指数增强型基金，根据标的指数市场表现，追求超越或超越沪深300所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

基金管理人 兴业全球基金管理有限公司

基金托管人 中国农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10月1日 - 2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -31,262,063.90

2.本期利润 124,654,404.41

3.加权平均基金份额本期利润 0.0802

4.期末基金资产净值 1,271,003,298.78

5.期末基金份额净值 0.8441

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利润的分配金额。

2.所述基金利润指包括持有人认购或申购本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投费、基金转换费等）在内所得利润并按所列示列数。

3.2 基金净值表现

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变动的比较

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 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 10.96% 1.22% 9.53% 1.22% 1.43% 0.00%

3.2.2 百分点

3.2.3 本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

基金净值增长率走势图与同期业绩比较基准收益率走势图

注1:净值表现所取数据截至到2012年12月31日。

2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)》基金合同的规定，本基金建仓期为2010年11月22日至2010年12月31日，建仓期结束时本基金各项资产的比例符合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助理简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

张惠萍 本基金基金经理 2010年4月22日 - 10年 1976年生，经济学硕士。2002年6月加入兴业基金管理有限公司，历任行业基金研究员、研究总监、兴全趋势投资组合经理、兴全趋势投资组合经理。

注1:职务指截至报告期末仍在担任的职务，报告期内离任的除外。

2.任职期间的从业年限。

3.本公司对从业人员的定期报告、基金年度报告、基金半年度报告等公开披露文本存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，基金管理人和基金托管人承担责任。

4.管理人对报告期内基金运作的合规性情况的说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，谨慎、勤勉、尽责地履行了受托人义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

5.管理人对报告期内基金的财务指标的说明

本基金报告期内，基金的财务指标符合基金合同的规定，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6.管理人对报告期内基金投资策略的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

7.管理人对报告期内基金估值政策的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

8.管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

9.管理人对报告期内基金的风险揭示

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

10.管理人对报告期内基金的会计政策、财务会计制度的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

11.管理人对报告期内基金的内部控制制度的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

12.管理人对报告期内基金的督察长履行职责的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

13.管理人对报告期内基金的信息披露的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

14.管理人对基金托管人的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

15.管理人对报告期内基金的审计的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

16.管理人对报告期内基金的合规经营情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

17.管理人对报告期内基金的年度报告的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

18.管理人对报告期内基金的年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

19.管理人对报告期内基金的年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

20.管理人对报告期内基金的年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

21.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

22.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

23.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

24.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

25.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

26.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

27.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

28.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

29.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

30.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

31.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

32.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

33.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

34.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

35.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

36.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

37.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

38.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

39.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

40.管理人对基金年度报告的披露情况的说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

41.管理人对基金年度报告的特别说明

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。

42.管理人对基金年度报告的复核意见

本基金在建仓期结束后，严格按照基金合同的约定，通过指数复制的方法构造跟踪沪深300指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的选股策略，谋求基金资产的长期增值。