兴全社会责任股票型证券投资基金

【2013】年度报告摘要

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2013年01月01日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	兴全社会责任股票
基金主代码	340007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月30日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,828,604,943.86份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,将定性与定量研究相结合,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。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业的基础上,采用"兴全双层行业筛选法"进行优化调整。采用"兴全社会责任四维选股模型"精选股票。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数
风险收益特征	较高风险、较高收益

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴业全球基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	田青
	联系电话	021-20398888	010-67595096
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099,021-38824536	010-67595096
传真		021-20398858	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xyfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年
本期已实现收益	1,079,679,958.92	-282,273,057.46	-344,770,322.44
本期利润	964,662,954.64	502,348,131.78	-1,649,996,930.20
加权平均基金份额本期利润	0.2290	0.1285	-0.3791
本期基金份额净值增长率	18.08%	11.49%	-25.49%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.1780	-0.0691	0.0028
期末基金资产净值	5,702,422,752.09	4,844,656,445.70	4,566,234,288.10
期末基金份额净值	1.489	1.261	1.131

注:1、上述财务指标采用的计算公式,详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第1号<主要财务指标的计算及披露>》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、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。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、上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:开放式基金的申购赎回费、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 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-4.24%	1.36%	-2.77%	0.91%	-1.47%	0.45%
过去六个月	2.34%	1.44%	5.66%	1.02%	-3.32%	0.42%
过去一年	18.08%	1.43%	-3.86%	1.09%	21.94%	0.34%
过去三年	-1.91%	1.22%	-18.04%	1.04%	16.13%	0.18%
过去五年	118.09%	1.31%	29.95%	1.23%	88.14%	0.08%
自基金合同生效起至今	69.67%	1.35%	-24.78%	1.42%	94.45%	-0.07%

注:本基金业绩比较基准为80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数,在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:中信标普300指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。中信标普300指数选择中国A股市场中市值规模最大、流动性强和基本因素良好的300家上市公司作为样本股,充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势,是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =80%×(中信标普300指数t / 中信标普300指数t-1 -1) +20%×(中信标普国债指数t / 中信标普国债指数t-1 -1)

Benchmark t =(1+Return t)×(1+Benchmark t-1)-1

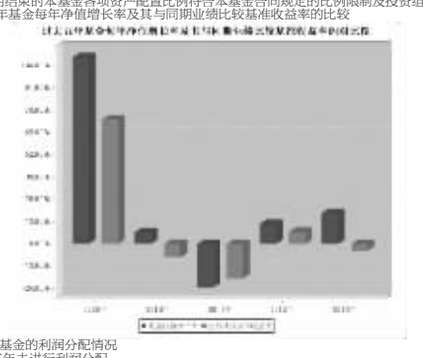
其中,t=1,2,3,… T,T表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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2013年12月31日。

2、按照《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2008年4月30日至2008年10月29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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴业全球基金管理有限公司是经中国证监会(证监基字[2003]100号文)批准,于2003年9月30日成立。2008年1月2日,中国证监会批准(证监许可[2008]6号)了公司股权变更申请,全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后,兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%,全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。同时公司名称由"兴业基金管理有限公司"更名为"兴业全球人寿基金管理有限公司"。 2008年7月7日,经中国证监会批准(证监许可[2008]888号文),公司名称由"兴业全球人寿基金管理有限公司"变更为"兴业全球基金管理有限公司",同时,公司注册资本由人民币1.2亿元变更为人民币1.5亿元。

截止2013年12月31日,公司旗下管理着十三只基金,分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选股票型证券投资基金(LOF)。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
傅鹏博	总经理助理、研究部总监、本基金基金经理	2009年1月16日	-	20年	1962年生,经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师,申银万国证券股份有限公司企业融资部经理、东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师;汇添富基金管理有限公司首席策略师;兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监、兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)基金经理。

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、《兴全社会责任股票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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴业全球基金管理有限公司公平交易制度》,并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范,从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

纵观2013年A股市场各大指数:上证指数跌6.75%,深成指跌10.91%,中小板指涨16.84%,创业板指与大盘形成鲜明对比,累计涨幅达83.23%。从各行业表现来看,采掘煤炭、有色、房地产、建材、银行金融、酿酒食品等走势较弱。而信息服务、信息设备、电子、家用电器、医药生物等涨幅居前,在经济结构转型期,行业的分化尤为明显。

2013年,A股市场走势基本是在经济复苏和改革两大预期动力驱动下演绎的跌宕起伏。全年市场走势呈现了三大波行情,分别在1月底、5月底和9月中到达相对高点,而4月底、6月底和11月初是相对低点。期间伴随着资本市场各种改革的推进。

从全球来看,金融危机以来,美国连续三波QE、欧洲持续维持低利率、日本"安倍经济学",2013年外围环境持续宽松,全球经济仍在缓慢而曲折的复苏轨迹中。宽松的货币环境驱动着全球股市上行,全球股市创下佳绩,日本与美国股市均出现了大幅度的上涨,取得2009年以来最好的年度回报。美国道琼斯、标普500指数、纳斯达克分别上涨了26.50%、29.60%、38.32%。法国CAC40、德国DAX、英国富时100等三大欧洲股指涨幅分别为17.99%、25.48%和14.43%。

回顾2013年,全球工业生产和贸易疲弱,价格水平回落,世界经济增速继续小幅回落。其中,发达国家增长动力略有增强,发展中国家困难重重。从经济数据看,年度经济增长7.7%,各季度间表现平稳。经济结构有所优化,第三产业的比重首次超过了第二产业。企业的主营业务的利润率也有所提高,工业企业净资产的增长速度没有下滑,而且单位产出的能源消耗在下降。CPI重回"2时代",成功达成调控目标,这一方面是因为政府消费性支出降低,另一方面也说明社会总需求增长较弱。PPI持续负增长,经济复苏虽然已经初现苗头,但仍然面临较大库存压力。因此,对于产能过剩行业的调控将继续,金融体系降杠杆将持续深化,短期仍无法期待流动性的改善。

本基金全年保持了一定的灵活度,自下而上优选个股的同时,积极参与结构性行情。同时,积极布局来年,深挖景气行业以及竞争力突出的公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率18.08%,同期业绩比较基准收益率-3.86%。

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2014年,海外经济基本平稳,主要经济体中,美国、欧洲仍将延续复苏趋势。伴随美国QE缩减启动,美元指数有望上行,资金或回流美国,新兴市场可能继续遭受冲击。新兴经济体增长分化,资源型国家受QE退出和美元走强的影响,收入和增长将受到抑制。因此,虽然中国经济的外部条件将延续变好,但流动性压力上升,会削弱外部经济复苏对出口的正面影响。

就国内经济而言,中国经济经历了五年增速放缓,经济下滑的幅度已然有限,但低位徘徊可能还将持续,经济转型的加速是可以期待的。短期看,经过两年的去库存,库存逐步见底,大宗商品触底回升,随着后续需求增长的修复,库存或在低位摆动中上升。中期看,过剩产能的淘汰仍将继续,有初步的迹象表明困扰经济体多年的,在最近两年时间里愈演愈烈的产能过剩问题似乎已经开始出现缓解的迹象。中国经济传统行业缓慢调整、消费服务缓慢回升的趋势已经建立。

改革是中国经济的长期课题,2014年是践行十八届三中全会改革方略的元年, 改革必将提升效率进而带来边际增长。不可否认,改革的推进依然是温和渐近式,各项制度红利的释放需要时间,可以提振短期信心,但仍然不会成为左右2014年经济运行的关键因素。然而,债务问题将逐渐浮现,2014年下半年开始大量到期的信托,资金链的拆补难度越来越大,信用风险部分暴露只是时间问题。债务问题是一个中期需要平衡解决的问题,不仅需要靠经济降杠杆,更需要中期的经济增长来化解。

流动性方面,在央行明确收紧货币政策的背景下,流动性紧张将会成为2014年的常态。2014年二级市场面临的资金压力较2013年整体上升,IPO的重启或引发二级市场资金面的分流效应。优先股等创新金融产品将分流部分长期投资资金,市场资金总体紧平衡。

综上情况,2014年的市场或触底回升,但整体难有大的趋势性机会。2014年的市场可能会在平淡的宏观基本面与乐观的政策预期相互纠结之中震荡反复。行业配置方面,周期类、成长类、消费类行业和个股均有不同程度的机会。2014年改革主题会贯穿全年,值得深入挖掘。我们将继续深挖个股,密切关注各行业的变化,跟踪政策的变化,从中寻找各类投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程,选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价,采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议,并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后,由IT人员或IT人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级,以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略,并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误;4、投资人员(包括基金经理)积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素,并就可能带来的影响提出建议和意见;5、监察稽核人员参与估值方案的制定,确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定,定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查,确保估值委员会决议的有效执行,负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有3年以上相关工作经历,具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内未进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 审计报告

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2014)审字第60467611_B05号
备注	投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文

§7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:兴全社会责任股票型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		54,977,047.66	224,484,225.74
结算备付金		17,335,101.89	22,431,608.59
存出保证金		1,630,943.76	1,440,460.46
交易性金融资产		5,555,159,154.82	4,558,306,354.89
其中:股票投资		5,260,059,154.82	4,337,600,657.89
基金投资		-	-
债券投资		295,100,000.00	220,705,697.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	165,000,000.00
应收证券清算款		90,072,896.82	3,823,107.04
应收利息		4,902,356.22	3,690,148.47
应收股利		-	-
应收申购款		2,459,519.39	7,617,097.22
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,726,537,020.56	4,986,793,002.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		156.14	122,123,929.84
应付赎回款		10,421,842.43	10,075,836.55
应付管理人报酬		7,259,489.74	5,703,080.71
应付托管费		1,209,914.97	950,513.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		4,652,077.97	1,974,000.64
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		570,787.22	1,309,195.53
负债合计		24,114,268.47	142,136,556.71
所有者权益:			
实收基金		3,828,604,943.86	3,843,136,113.11
未分配利润		1,873,817,808.23	1,001,520,332.59
所有者权益合计		5,702,422,752.09	4,844,656,445.70
负债和所有者权益总计		5,726,537,020.56	4,986,793,002.41

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.489 元,基金份额总额3,828,604,943.86份。

7.2 利润表

会计主体:兴全社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		1,104,812,035.82	599,505,358.72
1.利息收入		13,575,270.02	14,289,159.65
其中:存款利息收入		1,262,612.68	2,426,604.17
债券利息收入		8,113,832.33	3,704,724.58
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,198,825.01	8,157,830.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,203,481,493.23	-199,944,642.65
其中:股票投资收益		1,173,595,229.16	-246,680,775.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,411,300.68	-290,553.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		28,474,963.39	47,026,686.34
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-115,017,004.28	784,621,189.24
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		2,772,276.85	539,652.48
减:二、费用		140,149,081.18	97,157,226.94
1.管理人报酬		92,957,229.68	68,720,873.25
2.托管费		15,492,871.64	11,453,478.92
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		31,280,250.19	16,568,335.30
5.利息支出		4,872.42	-
其中:卖出回购金融资产支出		4,872.42	-
6.其他费用		413,857.25	414,539.47
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		964,662,954.64	502,348,131.78
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		964,662,954.64	502,348,131.78

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,843,136,113.11	1,001,520,332.59	4,844,656,445.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	964,662,954.64	964,662,954.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-14,531,169.25	-92,365,479.00	-106,896,648.25
其中:1.基金申购款	2,705,021,984.39	1,252,596,536.85	3,957,618,521.24
2.基金赎回款	-2,719,553,153.64	-1,344,962,015.85	-4,064,515,169.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,828,604,943.86	1,873,817,808.23	5,702,422,752.09
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,038,112,461.23	528,121,826.87	4,566,234,288.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	502,348,131.78	502,348,131.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-194,976,348.12	-28,949,626.06	-223,925,974.18
其中:1.基金申购款	598,027,005.21	101,200,604.62	699,227,609.83
2.基金赎回款	-793,003,353.33	-130,150,230.68	-923,153,584.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,843,136,113.11	1,001,520,332.59	4,844,656,445.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

兰荣 杨东 詹鸿飞

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴全社会责任股票型证券投资基金(原名兴业社会责任股票型证券投资基金)(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]356号文《关于核准兴业社会责任股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴业全球基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2008年4月30日正式生效,首次设立募集规模为1,388,696,479.84份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴业社会责任股票型证券投资基金。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。本基金为股票型基金,各类资产的投资比例为:股票投资比例为65%-95%;债券投资比例为0%-30%;资产支持证券占0%-20%;权证投资比例0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的5%。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的80%。

业绩比较基准为:80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司(以下简称"兴业全球基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(以下简称"兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	7,422,438,981.13	32.80%	2,543,118,617.44	23.16%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	510,000,000.00	2.37%	3,252,000,000.00	9.28%

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	5,176,236.07	29.94%	1,167,519.05	25.10%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
兴业证券	2,132,497.86	23.10%	188,488.60	9.55%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	92,957,229.68	68,720,873.25
其中:支付销售机构的客户维护费	14,385,442.74	11,877,034.30

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	15,492,871.64	11,453,478.92

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
期初持有的基金份额	36,301,701.90	13,304,663.21
期间申购/买入总份额	-	36,301,701.90
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	17,255,392.57	13,304,663.21
期末持有的基金份额	19,046,309.33	36,301,701.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.50%	0.94%

注:1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额,期间赎回/卖出总份额含转换出份额。2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定,符合公允性要求。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.