# 兴全社会责任股票型证券投资基金

## 【2014】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:中国建设银行股份有限公司**
**报告送出日期:2015年1月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年1月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 兴全社会责任股票 |
| 基金主代码 | 340007 |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,462,739,402.41份 |
| 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 |
| 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 |

### §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(2014年10月1日 - 2014年12月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 484,294,925.80 |
| 2.本期利润 | -33,086,009.24 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0123 |
| 4.期末基金资产净值 | 4,225,073,026.13 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.716 |

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。

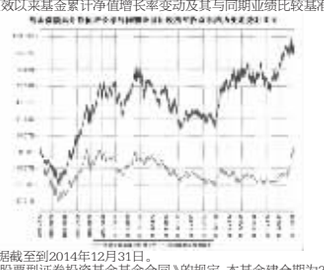
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.92% | 1.38% | 31.82% | 1.26% | -32.74% | 0.12% |

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



注:1、净值表现所取数据截至到2014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。

### §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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 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 | - | 21年 | 经济学硕士,历任上海财经大学经济管理系讲师,中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 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,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。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在非公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年四季度A股市场各大指数:上证指数涨36.8%,深成指涨36.3%,中小板指涨-2.6%,创业板指涨-4.5%。从各行业表现来看,金融行业、建筑、房地产、交通运输、公用事业等传统蓝筹行业走势强劲。而TMT、医药、轻工行业表现较差。

A股市场在2014年四季度走势仍然延续去年结构分化的行情,并且把这种结构化表现得特点丰富而鲜明,四季度大盘蓝筹独领风骚,引领整个市场进入"牛市"预期的疯狂之中,而小市值新兴产业类公司在前三季度累积了较大的涨幅后在四季度整体表现趋于平淡。

在经济整体平淡的环境下,本基金本季度继续保持了一定的灵活度,自下而上优选个股的同时,适度参与结构性行情。同时,积极布局与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为-0.92%,同期业绩比较基准收益率为31.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

就国内经济而言,四季度工业增速仍然较弱,但基建投资开始加速,房地产销售恢复明显,工业品价格总体表现稳定,进一步考虑到公共财政支出的可能走向,看起来目前经济正在底部整理,未来将逐步回升。最近几个月社会融资增速开始明显低于信贷增速,这显示银行表外业务、特别是非标业务正在出现快速收缩。这似乎部分地反映了房地产和地方融资平台正在进入去杠杆过程的影响,也与去年以来一系列规范影子银行活动的政策努力有关系。这些变化在推高了信贷和非标市场的利率水平的同时,通过引导资金更多地进入标准资产市场,可能也推动了票据贴现和中高等级信用债利率水平的回落,以及资本市场估值的恢复。

在整体经济走弱的背景下,许多代表未来发展方向的热点成为市场关注的焦点,各种主题在10月与11月进一步进入活跃期,中小板指与创业板综指在这波反弹中创出新高,其中并购外延预期类型或壳资源类型的股票普遍获得了较大的涨幅,我们认为这种市场结构性机会极度分化的现象难以持续,随着这些外延预期迅速被涨幅所兑现以及具有合理市值壳资源的迅速消灭,市场将以整体调整的形式结束这种分化行情并且寻找新的方向。

我们认为主流白马成长股的这种调整将进入后期阶段,对于成长空间仍然较大,成长模式与逻辑没有遭遇挑战的白马成长股已经逐渐接近或探明底部,我们已经可以在态度上变得逐渐积极起来,这些品种的跌幅已经有限,值得关注。另外,随着本次降息引发降息周期的预期带来短期一些投资机会,包括券商、地产等,这些板块估值较低,如果中国进入降息周期,带来无风险收益率的明显下行,可能会引导保险资金和居民资产进入股市,中长期市场风格向传统价值股领域回归,或会使这些板块执机会得以中期的延续。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §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 | 权益投资 | 3,938,368,657.73 | 91.87 |
| | 其中:股票 | 3,938,368,657.73 | 91.87 |
| 2 | 固定收益投资 | 200,055,000.00 | 4.67 |
| | 其中:债券 | 200,055,000.00 | 4.67 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 52,503,191.74 | 1.22 |
| 7 | 其他资产 | 95,774,083.52 | 2.23 |
| 8 | 合计 | 4,286,700,932.99 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,702,995,145.99 | 63.98 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 337,703,329.53 | 7.99 |
| E | 建筑业 | 21,074,726.40 | 0.50 |
| F | 批发和零售业 | 6,109,340.12 | 0.14 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 805,110,282.69 | 19.06 |
| J | 金融业 | 3,141,216.00 | 0.07 |
| K | 房地产业 | 10,341,575.00 | 0.24 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 51,893,042.00 | 1.23 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,938,368,657.73 | 93.21 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300017 | 网宿科技 | 7,785,953 | 375,282,934.60 | 8.88 |
| 2 | 600674 | 川投能源 | 16,290,561 | 337,703,329.53 | 7.99 |
| 3 | 000625 | 长安汽车 | 18,228,000 | 299,486,040.00 | 7.09 |
| 4 | 600867 | 通化东宝 | 18,558,000 | 289,504,800.00 | 6.85 |
| 5 | 600399 | 抚顺特钢 | 9,780,000 | 277,556,400.00 | 6.57 |
| 6 | 002450 | 康得新 | 8,348,000 | 241,841,560.00 | 5.72 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 6,742,172 | 186,623,320.96 | 4.42 |
| 8 | 300049 | 福瑞股份 | 5,329,069 | 173,194,742.50 | 4.10 |
| 9 | 002085 | 万丰奥威 | 6,532,009 | 173,098,238.50 | 4.10 |
| 10 | 002502 | 骅威股份 | 13,039,100 | 158,816,238.00 | 3.76 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 200,055,000.00 | 4.73 |
| | 其中:政策性金融债 | 200,055,000.00 | 4.73 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 200,055,000.00 | 4.73 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 140204 | 14国开04 | 1,000,000 | 100,020,000.00 | 2.37 |
| 2 | 140218 | 14国开18 | 500,000 | 50,035,000.00 | 1.18 |
| 3 | 140213 | 14国开13 | 500,000 | 50,000,000.00 | 1.18 |
| 4 | - | - | - | - | - |
| 5 | - | - | - | - | - |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 1,155,849.44 |
| 2 | 应收证券清算款 | 86,097,004.10 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 6,938,311.53 |
| 5 | 应收申购款 | 1,582,918.45 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 95,774,083.52 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600399 | 抚顺特钢 | 277,556,400.00 | 6.57 | 重大事项 |
| 2 | 002475 | 立讯精密 | 186,623,320.96 | 4.42 | 非公开发行 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,796,658,529.81 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 265,305,859.53 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 599,224,986.93 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列) | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 2,462,739,402.41 |

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 0.00 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准本基金设立的文件

2、《兴全社会责任股票型证券投资基金基金合同》

3、《兴全社会责任股票型证券投资基金托管协议》

4、《兴全社会责任股票型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站(http://www.xyfunds.com.cn)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

**兴业全球基金管理有限公司**
**2015年1月20日**

# 兴全添利宝货币市场基金

## 【2014】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:2015年1月20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2015年1月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年10月1日起至12月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 兴全添利宝货币 |
| 基金主代码 | 000575 |
| 交易代码 | 000575 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014年2月27日 |
| 报告期末基金份额总额 | 55,141,438,481.19份 |
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 根据宏观形势、利率走势等因素,确定各个阶段的投资组合平均久期、剩余期限等指标,并在这些指标要求的基础上构建投资组合;进行主动投资,有效提高资产组合收益。本基金综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金 |
| 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 |

### §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(2014年10月1日 - 2014年12月31日) |
|---|---|
| 1. 本期已实现收益 | 861,494,945.38 |
| 2.本期利润 | 861,494,945.38 |
| 3.期末基金资产净值 | 55,141,438,481.19 |

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

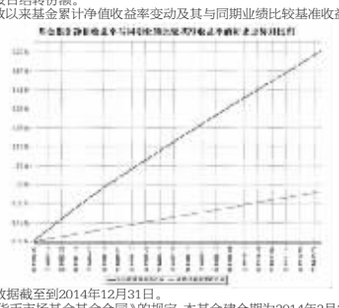
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 | 1.1502% | 0.0013% | 0.3403% | 0.0000% | 0.8099% | 0.0013% |

注:本基金收益分配按日结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年12月31日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2014年2月27日至2014年5月26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本基金投资组合的比例范围。

3、本基金成立于2014年2月27日,截止2014年12月31日,本基金成立不满一年。

### §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 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 张睿 | 本基金基金经理 | 2014年2月27日 | - | 9年 | 经济学硕士,历任红顶金融工程研究中心研究部经理、申银万国证券研究所高级分析师、兴业全球基金管理有限公司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理。 |
| 毛水荣 | 本基金、兴全保本混合型证券投资基金和兴全稳增利债券型证券投资基金基金经理 | 2014年6月10日 | - | 11年 | 经济学硕士。历任上海博弘投资管理有限公司投研部债券研究员;平安资产管理有限公司投资经理助理;华商基金管理有限公司基金经理助理、基金经理;2013年加入兴业全球基金管理有限公司。 |

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、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》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 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,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。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计,从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在非公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观、中观的数据显示,当前的基本面依然处于非常弱势的状态。在央行降息超过一个多月后,央行依然对全面降准有所顾忌,只是通过同业存款纳入各项存款而暂不缴准来曲线实现信贷宽松的目标,货币层面继续宽松的预期有所减弱,正是对于基本面弱势和货币宽松的预期减弱,收益率曲线变得过于平坦,尽管四季度经历了先下后上的v型调整,但期限10Y-1Y国债的利差也低于40BP;在新股提速,股市火爆,同业新规出台的后半季度,货币市场利率陡然上行,3个月SHIBOR调升至5%以上,直至年末。受股市持续火爆影响,本组合规模在四季度有一定程度的下降。运作期内,主要压低了现券配置的规模,保持合理的流动性,在收益上仍保持在具有吸引力的水平。

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为1.1502%,同期业绩比较基准收益率为0.3403%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度,银行间资金面极度紧张阶段过去,货币市场短端利率有从高位修复的需求,但频繁的新股发行无疑也加剧了资金波动性。信用债方面,2014年各等级,各品种,各行业信用债都跟随着利率债下行,信用利差尽数收窄,城投债呈现利率化特征,这些特征与经济下行不会长期同存,我们倾向于对低评级的信用债保持谨慎。本基金在后续操作上会更为积极,把握节奏,抓住关键时点锁定高收益存款和现券,提升组合的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §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 | 固定收益投资 | 18,682,315,561.49 | 32.44 |
| | 其中:债券 | 18,682,315,561.49 | 32.44 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,097,532,846.31 | 1.91 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 36,883,887,713.68 | 64.05 |
| 4 | 其他资产 | 918,599,690.67 | 1.60 |
| 5 | 合计 | 57,582,335,812.15 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 10.49 | |
| | 其中:买断式回购融资 | 0.00 | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 2,416,749,254.85 | 4.38 |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内未发生债券正回购资金余额超过基金资产净值20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 115 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 100 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限没有发生超过180天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 29.15 | 4.38 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)-60天 | 6.94 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)-90天 | 7.47 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.11 | - |
| 4 | 90天(含)-180天 | 32.06 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)-397天(含) | 27.14 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 102.76 | 4.38 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 470,250,883.10 | 0.85 |
| | 其中:政策性金融债 | 470,250,883.10 | 0.85 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 16,019,858,910.12 | 29.05 |
| 6 | 中期票据 | 2,192,205,768.27 | 3.98 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 18,682,315,561.49 | 33.88 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 59,855,678.44 | 0.11 |

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 041451037 | 14酒钢CP001 | 5,500,000 | 551,007,277.37 | 1.00 |
| 2 | 041453118 | 14酒钢CP002 | 4,700,000 | 470,083,616.17 | 0.85 |
| 3 | 011474003 | 14陕煤化SCP003 | 4,500,000 | 450,356,532.15 | 0.82 |
| 4 | 011474004 | 14陕煤化SCP004 | 4,200,000 | 419,857,414.35 | 0.76 |
| 5 | 041464005 | 14邕煤CP001 | 3,000,000 | 301,414,967.68 | 0.55 |
| 6 | 011481006 | 14淮南矿SCP006 | 3,000,000 | 299,935,225.68 | 0.54 |
| 7 | 011481003 | 14淮南矿SCP003 | 2,900,000 | 290,192,692.97 | 0.53 |
| 8 | 011415005 | 14中铝业SCP005 | 2,800,000 | 280,369,038.66 | 0.51 |
| 9 | 041465006 | 14北客钢铁CP001 | 2,500,000 | 249,880,777.82 | 0.45 |
| 10 | 140430 | 14农发30 | 2,100,000 | 210,473,027.57 | 0.38 |

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|---|---|
| 报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2032% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0389% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1206% |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照实际利率每日计提应收利息,2007年7月1日前按直线法,2007年7月1日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于397 天但剩余存续期超过397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

5.8.3 本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查。

5.8.4 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 918,599,690.67 |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 918,599,690.67 |

5.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 77,118,796,144.89 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 159,581,513,716.24 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 181,558,871,379.94 |
| 报告期期末基金份额总额 | 55,141,438,481.19 |

注:总申购份额含红利再投资。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 申购 | 2014年10月10日 | 25,000,000.00 | 25,000,000.00 | - |
| 2 | 申购 | 2014年10月14日 | 37,000,000.00 | 37,000,000.00 | - |
| 3 | 赎回 | 2014年10月20日 | -25,000,000.00 | -25,000,000.00 | - |
| 4 | 赎回 | 2014年10月30日 | -3,000,000.00 | -3,000,000.00 | - |
| 5 | 红利再投资 | 2014年10月31日 | 692,075.17 | 692,075.17 | - |
| 6 | 申购 | 2014年11月7日 | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 | - |
| 7 | 赎回 | 2014年11月12日 | -36,000,000.00 | -36,000,000.00 | - |
| 8 | 赎回 | 2014年11月19日 | -5,000,000.00 | -5,000,000.00 | - |
| 9 | 申购 | 2014年11月21日 | 23,000,000.00 | 23,000,000.00 | - |
| 10 | 申购 | 2014年11月25日 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | - |
| 11 | 赎回 | 2014年11月26日 | -42,000,000.00 | -42,000,000.00 | - |
| 12 | 申购 | 2014年11月28日 | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | - |
| 13 | 红利再投资 | 2014年11月30日 | 719,758.12 | 719,758.12 | - |
| 14 | 申购 | 2014年12月2日 | 45,000,000.00 | 45,000,000.00 | - |
| 15 | 申购 | 2014年12月4日 | 60,000,000.00 | 60,000,000.00 | - |
| 16 | 申购 | 2014年12月5日 | 25,000,000.00 | 25,000,000.00 | - |
| 17 | 赎回 | 2014年12月11日 | -25,000,000.00 | -25,000,000.00 | - |
| 18 | 赎回 | 2014年12月15日 | -30,000,000.00 | -30,000,000.00 | - |
| 19 | 赎回 | 2014年12月26日 | -12,000,000.00 | -12,000,000.00 | - |
| 20 | 红利再投资 | 2014年12月31日 | 1,330,551.13 | 1,330,551.13 | - |
| 合计 | | | 149,742,384.42 | 149,742,384.42 | |

注:1、"交易日期"为交易确认日或分红权益登记日。

2、因本基金收益分配按日结转份额,上表中"红利再投资"数据为当月汇总数据。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

### §9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予兴全添利宝货币市场基金募集注册的文件

2、关于募集兴全添利宝货币市场基金之法律意见书

3、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

4、基金托管人业务资格批件和营业执照

5、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》

6、《兴全添利宝货币市场基金托管协议》

7、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站(http://www.xyfunds.com.cn)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

**兴业全球基金管理有限公司**
**2015年1月20日**

# 兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金

## 【2014】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:2015年1月20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2015年1月19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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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 |
| 基金合同生效日 | 2009年3月25日 |
| 报告