

兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)

[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:招商银行股份有限公司

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。

基金财产净值以人民币为基准计算。本基金于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:兴全轻资产(LOF)

场内简称:兴全轻资

基金主代码:163412

交易代码:163412

前端交易代码:163412

后端交易代码:163413

基金运作方式:上市开放式基金(LOF)

基金合同生效日:2012年4月5日

报告期末基金份额总额:497,799,419.19份

基金类型:股票型基金(股票型)

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告期末基金资产净值:10,000,000.00元

报告期末基金份额净值:0.02025

基金总资产:956,521,996.02元

基金总负债:9,521,996.02元

基金份额净值:0.996521

基金合同生效以来基金累计净值增长率:1.92%

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2014年10月1日-2014年12月31日)

1.本期已实现收益 181,367,610.11

2.本期利润 42,626,518.93

3.本期基金份额本期利润 30,675,205.25

4.期末基金份额净值 0.996521

5.期末基金份额净值增长率 0.9965%

注:1.本基金管理人实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金估值表现

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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.51% 2.28% 35.30% 1.31% -32.79% 0.97%

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.本基金实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.3 资本利得(损失)情况

3.3.1 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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 2.51% 2.28% 35.30% 1.31% -32.79% 0.97%

3.3.2 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.本基金实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.4 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间 证券从业年限 说明

陈晓帆 基金经理 2012年4月5日 - 13年 工商管理硕士,历任北京挚基信息技术有限公司项目经理,北京挚基信息技术有限公司项目经理,兴业全球基金管理有限公司基金经理,兴全趋势投资股票型基金基金经理,兴全回报基金基金经理。

谢治宇 基金经理 2014年12月8日 - 6年 经济学硕士,加入兴业全球基金管理有限公司,历任兴业全球基金管理有限公司基金经理,兴全回报基金基金经理。

注:1.职务截止至报告期末的职务(或报告期末仍在任的或离任前的职务)(报告期末仍在任的)。
2.任日期即基金经理合同生效之日(基金成立即刻即担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理),离任日期即公司作出解聘决定之日。

3.证券从业年限,按实际从事证券工作的年限计算。

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,基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《兴全轻资产投资股票型基金(LOF)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、取信于社会的原则和诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则和诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的原则,严格履行了基金合同和基金托管协议的各项约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.公平交易制度的执行情况

本基金报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《兴全轻资产投资股票型基金(LOF)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、取信于社会的原则和诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的原则,严格履行了基金合同和基金托管协议的各项约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

6.信息披露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》、《证券投资基金管理办法》公平交易制度指

示意见》及公司相关制度,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节严格把关,确保各投资组合之间的公平交易,保护投资者的合法权益。公司已将相关制度对不同投资组合的公平交易和佣金分配等方面进行细化,对大宗交易和关联交易等方面制定严格的标准,对异常交易行为和业绩表现等方面进行重点监控,并严格监控和评估,确保公平交易和利益输送。

7.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。

8.11.2 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 985,575.86

2 应收证券清算款 25,971,186.39

3 应收股利 -

4 应收利息 27,495.92

5 应收申购款 4,526,718.44

6 其他应收款 -

7 折旧费用 -

8 其他 -

9 合计 31,510,976.61

注:1.职务截止至报告期末的职务(或报告期末仍在任的或离任前的职务)(报告期末仍在任的)。
2.任日期即基金经理合同生效之日(基金成立即刻即担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理),离任日期即公司作出解聘决定之日。

3.证券从业年限,按实际从事证券工作的年限计算。

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,基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其他各项实施细则,《兴全轻资产投资股票型基金(LOF)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、取信于社会的原则和诚实信用、勤勉尽责、取信于市场的原则,严格履行了基金合同和基金托管协议的各项约定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.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》、《证券投资基金管理办法》公平交易制度指

示意见》及公司相关制度,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节严格把关,确保各投资组合之间的公平交易,保护投资者的合法权益。公司已将相关制度对不同投资组合的公平交易和佣金分配等方面进行细化,对大宗交易和关联交易等方面制定严格的标准,对异常交易行为和业绩表现等方面进行重点监控,并严格监控和评估,确保公平交易和利益输送。

6.信息披露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》、《证券投资基金管理办法》公平交易制度指

示意见》及公司相关制度,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节严格把关,确保各投资组合之间的公平交易,保护投资者的合法权益。公司已将相关制度对不同投资组合的公平交易和佣金分配等方面进行细化,对大宗交易和关联交易等方面制定严格的标准,对异常交易行为和业绩表现等方面进行重点监控,并严格监控和评估,确保公平交易和利益输送。

7.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。

8.11.2 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。

5.11.4 基金报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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 110200 南山转债 833,640 116,384,400.4 13.87

2 1382130 13通达债MTN1 700,000 69,040,000.0 8.32

3 122143 12亿邦债 663,350 67,895,213.10 8.09

4 1382187 13东安MTN3 700,000 67,823,000.0 8.08

5 124043 12深物业A 667,060 66,072,933.0 7.87

注:1.本期已实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.3 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.本期已实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.4 基金管理人持有或有基金资产净值情况

3.4.1 本期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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 21.18% 1.37% 35.30% 1.31% -14.12% 0.06%

3.4.2 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.本期已实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.5 基金管理人持有或有基金资产净值情况

3.2.6 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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 21.18% 1.37% 35.30% 1.31% -14.12% 0.06%

3.2.7 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.本期已实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.8 基金管理人持有或有基金资产净值情况

3.2.9 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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 21.18% 1.37% 35.30% 1.31% -14.12% 0.06%

3.2.10 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.本期已实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.11 基金管理人持有或有基金资产净值情况

3.2.12 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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 21.18% 1.37% 35.30% 1.31% -14.12% 0.06%

3.2.13 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.本期已实现收益指基金本期利润收入,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申购基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投、基金转换费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.14 基金管理人持有或有基金资产净值情况

3.2.15 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变动的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去三个月 21.18% 1.37% 35.30% 1.31% -14