

兴全保本混合型证券投资基金

[2015] 第二季度报告

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
报告日期：2015年6月30日
基金额度的董事会及监事会在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。
基金管理人和基金托管人根据本基金合同的规定，于2015年7月17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重要信息，保证复核结果与本报告一致。复核结果表明，本报告的内容真实、准确、完整。

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。

本报告所列财务数据未经审计。

基金合同自2010年6月1日起至2030年6月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称：兴全保本混合

基金主代码：163411

交易代码：163411

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2011年8月3日

报告期末基金份额总额：1,240,089,480.91份

投资目标：本基金通过对标的组合配置策略，在确保本基金到期时的保本率的基础上，寻求组合资产的稳定增长。

投资策略：1.基于可转债投资的OPW策略，即通过转换组合策略来达到对冲期间，利用可转债自身属性来免受因频繁买卖低风险资产与风险资产对比带来的影响，从而降低组合波动率；
2.可转债与股替代的TIPPP策略，即采取一定时间的动态投资策略，将可转债持有组合转换成股票，本基金将根据市场情况或全部代替股票持有TIPPP策略来实现组合保值。

§ 3 主要财务指标

单位：人民币元

报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1.本期已实现收益 74,072,270.45

2.本期利润 108,636,074.74

3.加权平均基金份额本期利润 0.0563

4.期末基金资产净值 2,103,265,400.63

5.期末基金份额净值 1.2087

注：1.本期收入项目包括利息收入、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减去费用后的余额。
2.所述本期利润不包括持有人认购或申购（认沽）、赎回或转换形成的收入（例如：申购或赎回、基金转换等），计价期间的实际收益水平将予以披露。

3.2 基金的净值表现

3.2.1 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) 业绩比较基准收益率标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 3.70% 1.18% 0.91% 0.01% 2.79% 1.17%

3.2.2 基金合同生效以来基金的累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：1.净值增长率所取数据截至到2015年6月30日。
2.本基金《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金合同期为2011年8月3日至2012年2月2日。建仓期结束时本基金各投资资产均符合基金合同规定的投资限制及投资组合比例的有关规定。
3.其他指标

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

杨云 经理助理、固定收益总监、本基金基金经理兼固定收益部总监、兴业全球基金管理有限公司基金经理 2011年8月3日 - 13年 理学硕士，历任申银万国证券研究所、兴业全球基金管理有限公司基金经理。2011年加入兴业全球基金管理有限公司基金经理助理、兴业全球基金管理有限公司基金经理。

毛水军 本基金 兴全稳健增值债券型基金基金经理 2014年7月23日 - 12年 管理学硕士，历任上海浦东发展银行、平安资产管理有限公司基金经理，平安资产管理有限公司投资经理助理、华夏基金管理有限公司基金经理，易方达基金管理有限公司基金经理，易方达基金管理有限公司基金经理助理。2013年加入兴业全球基金管理有限公司。

2.任日期前基金管理人发生变更（如基金名称变更、基金托管人变更、基金名称变更后基金托管人未变、基金名称变更后基金托管人发生变更）之日前一日，基金管理人向决定之日起之日（基金成立后担任基金经理）离任日期前一日解聘之日。

3.“正从本基金”指从本基金开始担任基金经理之日起，该基金经理管理的其他基金。

4.本基金合同生效后，基金管理人不得增加新的收费项目，除非法律法规或中国证监会另有规定。

5.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

6.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

7.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

8.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

9.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

10.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

11.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

12.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

13.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

14.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

15.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

16.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

17.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

18.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

19.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

20.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

21.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

22.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

23.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

24.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

25.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

26.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

27.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

28.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

29.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

30.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

31.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

32.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

33.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

34.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

35.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

36.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

37.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

38.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

39.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

40.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

41.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

42.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

43.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

44.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

45.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

46.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

47.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

48.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

49.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

50.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

51.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

52.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

53.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

54.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

55.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

56.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

57.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

58.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

59.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

60.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

61.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

62.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

63.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

64.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

65.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

66.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

67.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

68.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

69.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

70.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

71.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

72.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

73.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

74.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

75.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

76.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

77.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

78.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

79.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

80.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

81.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

82.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

83.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

84.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

85.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

86.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

87.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

88.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

89.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

90.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

91.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

92.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

93.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

94.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。

95.本基金的客户服务电话：400-633-0999，客户服务邮箱：service@xyfunds.com.cn。

96.本基金的客户服务网站：http://www.xyfunds.com.cn。