

## 兴全保本混合型证券投资基金

## [2015] 第三季度报告

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10月24日  
§ 1 重要提示  
基金管理人的董事、监事及高级管理人员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、完整性承担个别及连带责任。  
基金合同由基金管理人与基金托管人根据本基金合同规定，于2015年7月22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。  
基金经理人徐云对本基金运作情况负有领导责任，但不保证基金一定盈利。  
基金销售机构以诚实信用、勤勉尽责的原则履行基金销售职责，但不保证基金一定盈利。  
本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者购买基金，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。  
本报告分析的基金资料未经审计。

本报告期间自2015年1月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴全保本混合
基金代码	163411
交易代码	163411
基金份额总额	-
最后交易日	2014年12月24日
基金合同期限	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月13日
报告期间基金份额总额	1,340,367,760.13份
投资目标	本基金通过特定组合保险策略，在确保保本期到期时的保本保值的基础上，寻找组合资产的稳定增长，同时通过长期股权投资和短期投资所形成的看涨期权，利用杠杆自身的特点，规避因为期限错配而带来的风险，从而获得比单纯的股票投资更高的收益。
投资策略	2. 可持续性和可持续性的IPV策略：即采用时间不变性投资组合保险策略实现本目标。同时，可转债市场无风险溢价相对较低，本基金将投资于部分可转债，从而实现组合保险策略。
投资范围	本基金通过特定组合保险策略，在确保保本期到期时的保本保值的基础上，寻找组合资产的稳定增长，同时通过长期股权投资和短期投资所形成的看涨期权，利用杠杆自身的特点，规避因为期限错配而带来的风险，从而获得比单纯的股票投资更高的收益。
投资策略	2. 可持续性和可持续性的IPV策略：即采用时间不变性投资组合保险策略实现本目标。同时，可转债市场无风险溢价相对较低，本基金将投资于部分可转债，从而实现组合保险策略。
业绩比较基准	当年定期存款利率(税后)+股票型基金指数
风险收益特征	本基金为保本混合基金，属于证券投资基金中的低风险品种。
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
基金类别	深圳市高富投资顾问有限公司
§ 3 主要财务指标/基金净值表现	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)
1.本期已实现收益	53,845,435.80
2.本期利润	-74,369,246.80
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0526
4.期末基金份额净值	1,563,117,234.89
5.期末基金份额净值	1.1662

注：1.本期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）和损失（费用）的余额，本期利润为当期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）减去申购赎回费用、基金转换费等，基金本期利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资、基金转换费等），计算费用时实际收益额以扣除非费用后的金额为准。  
2.基金净值的表现不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资、基金转换费等），计算费用时实际收益额以扣除非费用后的金额为准。

3.2 报告期内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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④
过去三个月	-35.52%	0.69%	0.81%	0.01%

注：1.净值增长率计算方法见本基金合同第十一部分“基金的收益”；  
2.报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)的净值增长率=报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额总的回报率/报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额净值的初始面值。  
3.3 其他指标

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 管理人报告

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	162,062,876.02	7.37
2	固定收益投资	1,892,594,455.85	86.12
3	货币支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,347,670.21	1.70
7	其他资产	105,550,368.49	4.80
8	合计	2,197,535,370.57	100.00

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

5.3 主要财务指标/基金净值表现

基金简称	兴全保本混合	兴全保本
基金代码	1634006	1634006
交易账户代码	-	-
基金合同生效日	2010年4月10日	2010年4月10日
报告期末基金份额总额	1,563,117,234.89	1,563,117,234.89

注：1.基金通过定期存款、债券回购、货币市场基金等低风险资产，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）和损失（费用）的余额，本期利润为当期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）减去申购赎回费用、基金转换费等，基金本期利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资、基金转换费等），计算费用时实际收益额以扣除非费用后的金额为准。  
2.报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)的净值增长率=报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额总的回报率/报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额净值的初始面值。  
3.3 其他指标

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 管理人报告

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	162,062,876.02	7.37
2	固定收益投资	1,892,594,455.85	86.12
3	货币支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,347,670.21	1.70
7	其他资产	105,550,368.49	4.80
8	合计	2,197,535,370.57	100.00

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

5.3 主要财务指标/基金净值表现

基金简称	兴全保本混合	兴全保本
基金代码	1634006	1634006
交易账户代码	-	-
基金合同生效日	2010年4月10日	2010年4月10日
报告期末基金份额总额	1,563,117,234.89	1,563,117,234.89

注：1.基金通过定期存款、债券回购、货币市场基金等低风险资产，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）和损失（费用）的余额，本期利润为当期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）减去申购赎回费用、基金转换费等，基金本期利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资、基金转换费等），计算费用时实际收益额以扣除非费用后的金额为准。  
2.报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)的净值增长率=报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额总的回报率/报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额净值的初始面值。  
3.3 其他指标

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 管理人报告

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	162,062,876.02	7.37
2	固定收益投资	1,892,594,455.85	86.12
3	货币支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,347,670.21	1.70
7	其他资产	105,550,368.49	4.80
8	合计	2,197,535,370.57	100.00

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

5.3 主要财务指标/基金净值表现

基金简称	兴全保本混合	兴全保本
基金代码	1634006	1634006
交易账户代码	-	-
基金合同生效日	2010年4月10日	2010年4月10日
报告期末基金份额总额	1,563,117,234.89	1,563,117,234.89

注：1.基金通过定期存款、债券回购、货币市场基金等低风险资产，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）和损失（费用）的余额，本期利润为当期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）减去申购赎回费用、基金转换费等，基金本期利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资、基金转换费等），计算费用时实际收益额以扣除非费用后的金额为准。  
2.报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)的净值增长率=报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额总的回报率/报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额净值的初始面值。  
3.3 其他指标

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 管理人报告

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	162,062,876.02	7.37
2	固定收益投资	1,892,594,455.85	86.12
3	货币支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	37,347,670.21	1.70
7	其他资产	105,550,368.49	4.80
8	合计	2,197,535,370.57	100.00

5.2 报告期按行业分类的股票投资组合

5.3 主要财务指标/基金净值表现

基金简称	兴全保本混合	兴全保本
基金代码	1634006	1634006
交易账户代码	-	-
基金合同生效日	2010年4月10日	2010年4月10日
报告期末基金份额总额	1,563,117,234.89	1,563,117,234.89

注：1.基金通过定期存款、债券回购、货币市场基金等低风险资产，投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）和损失（费用）的余额，本期利润为当期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）减去申购赎回费用、基金转换费等，基金本期利润不包括持有人认购或交易本基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资、基金转换费等），计算费用时实际收益额以扣除非费用后的金额为准。  
2.报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)的净值增长率=报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额总的回报率/报告期(2015年7月1日至2015年9月30日)期间每份基金份额净值的初始面值。  
3.3 其他指标

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

4.2 管理人报告

5.1 报告期内基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	162,062,876.02	7.37
2	固定收益投资	1,892,594,455.8	