

兴全可转债混合型证券投资基金

2012 年年度报告摘要

2012 年 12 月 31 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2013 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 月 22 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 2012 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	兴全可转债混合
基金主代码	340001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,474,879,515.88 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市

	上涨的收益；运用“兴全可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×天相可转债指数+15%×中信标普 300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	蒋松云
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398858	010-66105798

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	2012 年	2011 年	2010 年
本期已实现收益	-223,174,566.01	-34,634,012.64	355,738,697.04
本期利润	62,996,751.32	-600,713,568.69	382,225,978.40
加权平均基金份额本期利润	0.0166	-0.1598	0.1233
本期基金份额净值增长率	1.70%	-13.68%	7.65%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0852	-0.0248	0.0325
期末基金资产净值	3,613,922,966.37	3,949,109,132.37	4,822,972,711.51
期末基金份额净值	1.0400	1.0226	1.2316

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	3.40%	0.46%	4.96%	0.43%	-1.56%	0.03%
过去六个月	-1.12%	0.43%	1.28%	0.39%	-2.40%	0.04%
过去一年	1.70%	0.47%	4.11%	0.44%	-2.41%	0.03%
过去三年	-5.49%	0.56%	-19.55%	0.63%	14.06%	-0.07%
过去五年	2.68%	0.69%	-35.95%	1.00%	38.63%	-0.31%
自基金合同生效起至今	292.49%	0.74%	95.58%	1.01%	196.91%	-0.27%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：选取天相可转债指数和中信标普 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“天相可转债指数”是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。中信标普 300 指数代表效果较好。

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：

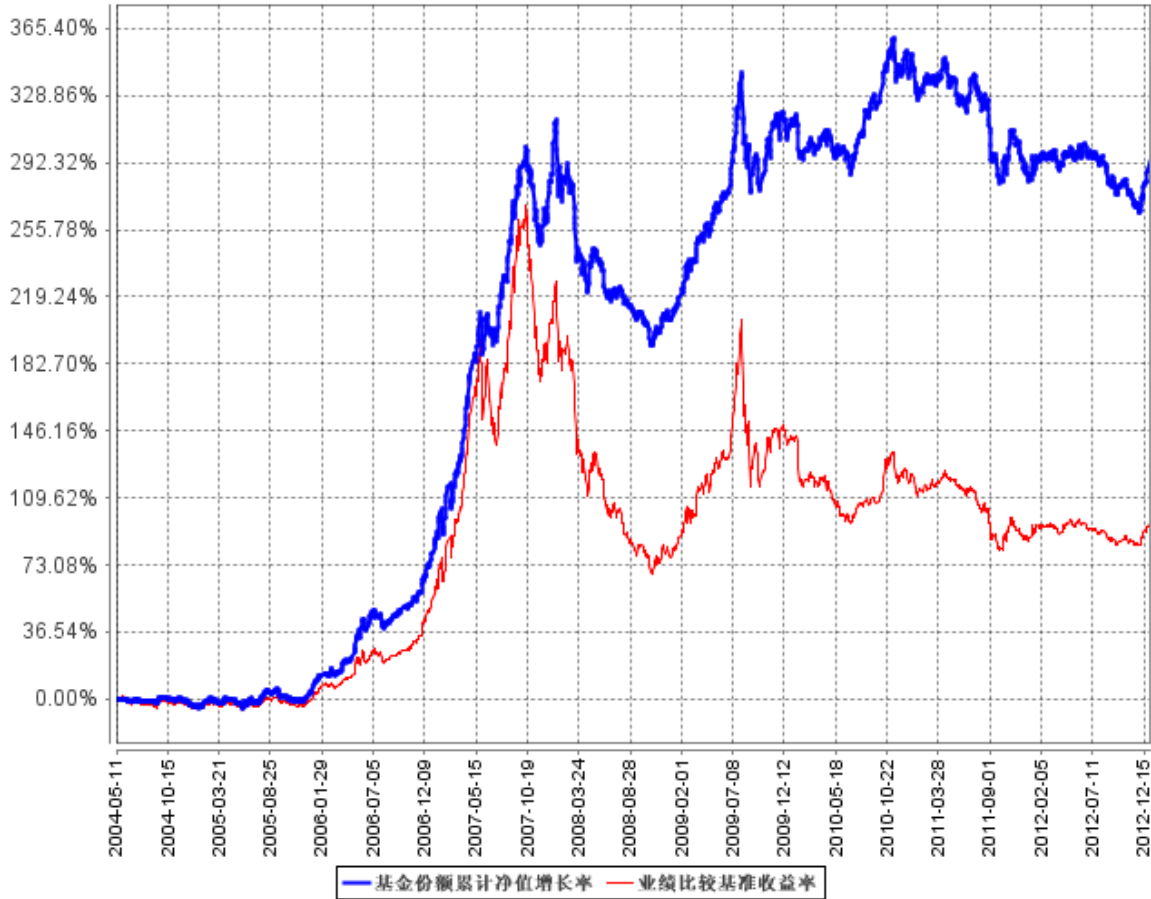
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{天相可转债指数}_t / \text{天相可转债指数}_{t-1} - 1) + 15\% \times (\text{中信标普 300 指数}_t / \text{中信标普 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

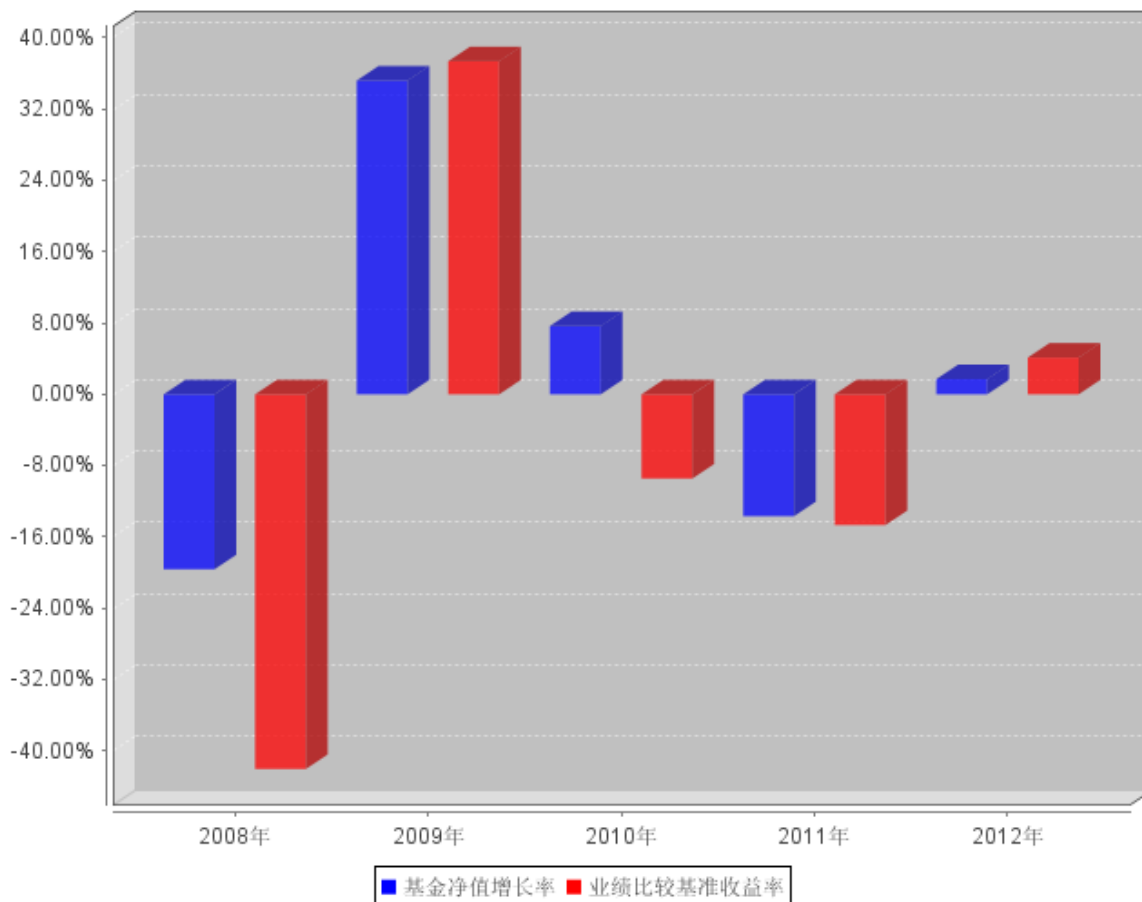


注：1、净值表现所取数据截至到 2012 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2004 年 5 月 11 日至 2004 年 11 月 10 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

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对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012	-	-	-	-	
2011	0.470	74,330,488.06	105,781,669.76	180,112,157.82	
2010	1.170	111,194,648.78	233,052,198.36	344,246,847.14	
合计	1.640	185,525,136.84	338,833,868.12	524,359,004.96	

§ 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（证监基金字[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 2012 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		
杨云	本基金和兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2007 年 2 月 6 日	-	10 年	1974 年生，理学硕士，历任申银万国证券研究所金融工程部、策略部研究员；兴全可转债混合型证券投资基金的基金经理助理。

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合规守信情况的说明

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、《兴全可转债混合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。

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

2012 年的股市走出了比较教科书的走势，与经济及政策变化的步调较为一致，同时在经济艰难的情况下仅选择温和的货币政策调整也是政策的干扰相对较少的一年。年初的反弹虽然有一点基本面的变化，但也只是 PMI 数据的扰动，更多的是经济在持续的回落后市场对政策充满了较强的期待，随后无论是经济的复苏还是更强劲刺激政策的出台很快都被证伪，市场后续经历了长达 9 个月左右的调整。年底在经济复苏格局基本比较确定的背景下，市场才迎来了快速的大幅反弹，并带动上证指数年线收红。全年来看，金融、地产、汽车等低估值、大市值权重板块表现优异。

2012 年转债市场虽不能与信用债相比，但全年表现尚可，信用债的强势和正股的下跌是转债表现相对一般的主要原因。年初在市场反弹以及中石化修正转股价格后股性较好的带动下，转债有一轮较好的表现，随后即进入漫漫下跌，直至 12 月份随股市反弹带动转债更为强势的一轮反弹。

伴随着金融脱媒化以及社会融资结构变化的进一步加剧，债券市场上呈现一定分化——利率债表现相对平淡，而信用债尤其是中低评级信用债表现较好，中低等级券种收益率全面走低，对收益率的过度追求我们认为正在孕育债券市场的系统性风险。值得一提的是，在信用债收益率普遍走低的同时，一些信用风险事件逐步增多。

2012 年本基金运作相对欠佳，主要在两方面：1、年初在市场反弹后，并没有坚定执行既定的方向策略，退出不够坚决，使得在随后的漫漫熊途中受损较大；2、基金重仓的股票表现不好，跌幅超预期，没能及时调整，成为 2012 年最大的业绩拖累。总体来讲，基金 2012 年在可转债方面所犯错误相对较少，而股票上的错误损失较大，对市场整体风格的变化反应有些迟钝，也是基金未来投资中值得引起重视的教训。从过去一年的情况来看，固定收益类基金及产品的大发展也推动了转债投资者结构的较大变化，从而也推动着转债的一些定价机制的变化，包括各种金融工具的运用等，值得本基金在未来关注和学习。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为 1.70%，同期业绩比较基准收益率为 4.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年投资者面对的最大风险是经济减速和因此带来的盈利下滑，2013 年盈利下滑的趋势可能得到遏制，另一方面，通胀在上半年就会有温和的反弹，但尚不足以构成主要考虑的风险。因此股市在上半年的风险将不大，热点会层出不穷。如果央行的货币政策微调适当，股市全年来看可能整体上行空间已不大，但不存在较大风险。但如果上半年货币一直保持非常宽松的状况，则下半年可能面临通胀的再次抬头，因此 2013 年无论是股市还是债市主要的风险可能都发生在下半年。债市目前的收益率水平结合通胀和经济的情况来看，吸引力已经不大，甚至存在一定的风险。相对而言，2013 年股市和偏权益的转债将比固定收益更有吸引力。

2013 年我们在股票投资策略上会相对保持积极的心态去寻找机会，但规避个股的风险将依然非常重要，股市的分化正如经济面临的结构调整一样，很多公司目前的价格依然存在较大的风险。在可转债投资上我们将更注重前瞻性和对各种金融工具的运用，目前的可转债在机会和估值上都已相对处于中性，最好的时间段已经过去。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基

础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司监察稽核部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司监察稽核部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易室的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次，收益分配比例不低于净收益的 90%，收益分配后基金份额净值不能低于面值。本报告期内本基金未实施利润分配，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

2012 年，本基金托管人在对兴全可转债混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2012 年，兴全可转债混合型证券投资基金的管理人——兴业全球基金管理有限公司在兴全可转债混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴全可转债混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对兴业全球基金管理有限公司编制和披露的兴全可转债混合型证券投资基金 2012 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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（2013）审字第 60467611_B01 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：兴全可转债混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		70,803,230.08	141,619,241.58
结算备付金		2,065,227.04	2,230,761.99
存出保证金		799,056.93	848,780.49
交易性金融资产		3,354,552,526.63	3,772,565,635.48
其中：股票投资		897,542,483.08	693,703,910.47
基金投资		-	-
债券投资		2,457,010,043.55	3,078,861,725.01
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		100,000,000.00	-
应收证券清算款		81,892,385.67	-
应收利息		12,675,353.02	16,705,322.56
应收股利		-	-
应收申购款		772,041.09	91,291,058.45
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,623,559,820.46	4,025,260,800.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 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		-	67,268,030.12
应付赎回款		2,936,421.69	2,530,546.10
应付管理人报酬		3,842,786.70	4,187,318.72
应付托管费		738,997.47	805,253.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,165,702.38	504,846.98
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		952,945.85	855,672.66
负债合计		9,636,854.09	76,151,668.18
所有者权益：			
实收基金		3,474,879,515.88	3,861,722,014.09
未分配利润		139,043,450.49	87,387,118.28
所有者权益合计		3,613,922,966.37	3,949,109,132.37
负债和所有者权益总计		3,623,559,820.46	4,025,260,800.55

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0400 元，基金份额总额 3,474,879,515.88 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一、收入		132,907,871.96	-523,986,693.61
1. 利息收入		32,884,989.78	33,071,135.22
其中：存款利息收入		1,705,076.71	2,517,882.21
债券利息收入		30,354,504.06	28,164,166.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		825,409.01	2,389,086.60
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-186,573,980.88	7,425,546.15
其中：股票投资收益		-119,260,022.47	-26,301,932.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-76,792,326.98	27,125,633.24
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		9,478,368.57	6,601,845.28
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		286,171,317.33	-566,079,556.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		425,545.73	1,596,181.07
减：二、费用		69,911,120.64	76,726,875.08
1. 管理人报酬		50,966,153.39	54,909,581.04
2. 托管费		9,801,183.38	10,559,534.84
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用		8,415,168.13	9,116,463.95
5. 利息支出		404,000.39	1,816,181.06
其中：卖出回购金融资产支出		404,000.39	1,816,181.06
6. 其他费用		324,615.35	325,114.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,996,751.32	-600,713,568.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,996,751.32	-600,713,568.69

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	3,861,722,014.09	87,387,118.28	3,949,109,132.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	62,996,751.32	62,996,751.32
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）	-386,842,498.21	-11,340,419.11	-398,182,917.32
其中：1. 基金申购款	460,994,319.34	14,825,078.81	475,819,398.15
2. 基金赎回款	-847,836,817.55	-26,165,497.92	-874,002,315.47
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）	3,474,879,515.88	139,043,450.49	3,613,922,966.37
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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）	3,915,867,351.43	907,105,360.08	4,822,972,711.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-600,713,568.69	-600,713,568.69
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）	-54,145,337.34	-38,892,515.29	-93,037,852.63

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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 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]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

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。

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
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	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

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	1,296,043,264.42	23.97%	1,177,323,287.98	21.25%

7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
兴业证券	304,020,477.50	10.81%	392,353,916.71	10.91%

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	30,000,000.00	2.22%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本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 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	1,121,365.99	22.78%	13,503.86	1.16%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	1,003,216.58	20.41%	30,223.41	5.99%

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	50,966,153.39	54,909,581.04
其中：支付销售机构的客户维护费	6,583,864.46	8,320,964.78

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30% 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×1.30%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	9,801,183.38	10,559,534.84

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
期初持有的基金份额	112,488,422.29	108,151,861.71
期间申购/买入总份额	-	4,336,560.58
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	100,000,000.00	-
期末持有的基金份额	12,488,422.29	112,488,422.29

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.36%	2.91%
-----------------------	-------	-------

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持有本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	70,803,230.08	1,612,302.18	141,619,241.58	2,411,975.27

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
兴业证券	002594	比亚迪	首次公开发行	2,000,000	36,000,000.00

注：本基金上年度可比期间参与了比亚迪股份有限公司（002594）A股发行，该股票此次发行的副主承销商之一兴业证券股份有限公司是本基金管理人的控股股东。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002298	鑫龙电器	2012年7月18日	2013年7月19日	认购非公开发行证券	6.72	7.53	2,769,700	18,612,384.00	20,855,841.00	-
000826	桑德环境	2012年12月31日	2013年1月9日	认购配售证券	12.71	22.99	25,473	323,761.83	585,624.27	-

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127001	海直转债	2012年12月24日	2013年1月7日	认购新发债券	100.00	100.00	32,120	3,212,000.00	3,212,000.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2012年12月26日	重大事项公告	10.12	2013年1月21日	11.13	2,248,588	21,851,346.32	22,755,710.56	-
300006	莱美药业	2012年11月22日	重大事项公告	18.25	2013年1月31日	20.08	204,743	3,556,324.34	3,736,559.75	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	897,542,483.08	24.77
	其中：股票	897,542,483.08	24.77
2	固定收益投资	2,457,010,043.55	67.81
	其中：债券	2,457,010,043.55	67.81
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,000.00	2.76
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	72,868,457.12	2.01
6	其他各项资产	96,138,836.71	2.65
7	合计	3,623,559,820.46	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	81,462,174.20	2.25
B	采掘业	2,554,599.72	0.07
C	制造业	428,119,878.45	11.85
C0	食品、饮料	56,774,972.60	1.57
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	137,905,856.00	3.82
C5	电子	18,620,616.65	0.52
C6	金属、非金属	46,187,880.28	1.28
C7	机械、设备、仪表	89,913,009.02	2.49
C8	医药、生物制品	45,346,657.45	1.25
C99	其他制造业	33,370,886.45	0.92
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,322,500.00	0.06
E	建筑业	2,951,003.90	0.08
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	56,181,641.93	1.55
I	金融、保险业	284,572,973.69	7.87

J	房地产业	36,840,052.00	1.02
K	社会服务业	2,537,659.19	0.07
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	897,542,483.08	24.84

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,285,435	148,797,351.15	4.12
2	600143	金发科技	25,000,000	134,750,000.00	3.73
3	601166	兴业银行	5,438,966	90,776,342.54	2.51
4	002477	雏鹰农牧	4,356,266	81,462,174.20	2.25
5	601601	中国太保	1,999,968	44,999,280.00	1.25
6	002582	好想你	2,471,130	41,440,850.10	1.15
7	600529	山东药玻	4,476,509	39,840,930.10	1.10
8	002594	比亚迪	1,639,847	33,370,886.45	0.92
9	601100	恒立油缸	2,843,751	31,992,198.75	0.89
10	300228	富瑞特装	869,163	29,551,542.00	0.82

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站 <http://www.xyfunds.com.cn> 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	319,705,856.66	8.10
2	601166	兴业银行	205,045,887.77	5.19
3	600143	金发科技	161,923,123.23	4.10
4	002304	洋河股份	114,432,506.75	2.90
5	601601	中国太保	105,685,731.23	2.68
6	000002	万科A	74,201,032.63	1.88
7	002477	雏鹰农牧	73,051,232.01	1.85
8	600750	江中药业	61,387,084.32	1.55
9	002594	比亚迪	60,265,088.14	1.53

10	600519	贵州茅台	58,888,800.70	1.49
11	601633	长城汽车	54,117,541.26	1.37
12	002582	好想你	49,701,161.38	1.26
13	600028	中国石化	49,664,289.17	1.26
14	601988	中国银行	47,621,436.07	1.21
15	002007	华兰生物	44,475,576.76	1.13
16	600208	新潮中宝	43,899,212.89	1.11
17	002393	力生制药	43,704,471.37	1.11
18	000401	冀东水泥	39,267,369.57	0.99
19	000858	五粮液	36,655,850.83	0.93
20	002353	杰瑞股份	34,238,547.34	0.87

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	187,686,451.35	4.75
2	600143	金发科技	172,221,406.40	4.36
3	601166	兴业银行	133,739,547.46	3.39
4	600519	贵州茅台	110,251,619.50	2.79
5	000869	张裕A	88,923,427.02	2.25
6	002594	比亚迪	86,942,347.91	2.20
7	002304	洋河股份	79,670,030.81	2.02
8	000776	广发证券	70,211,204.70	1.78
9	601601	中国太保	61,666,153.48	1.56
10	002118	紫鑫药业	53,229,974.60	1.35
11	600750	江中药业	51,382,551.12	1.30
12	601633	长城汽车	51,277,246.07	1.30
13	000002	万科A	50,976,920.18	1.29
14	600028	中国石化	48,886,486.60	1.24
15	601988	中国银行	46,883,990.15	1.19
16	600779	水井坊	46,635,406.51	1.18
17	002393	力生制药	41,207,210.32	1.04
18	600208	新潮中宝	41,059,154.86	1.04
19	002353	杰瑞股份	40,318,801.12	1.02
20	000401	冀东水泥	40,127,808.66	1.02

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,863,045,364.88
卖出股票收入（成交）总额	2,610,415,140.44

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	99,820,000.00	2.76
3	金融债券	19,686,000.00	0.54
	其中：政策性金融债	19,686,000.00	0.54
4	企业债券	109,049,672.00	3.02
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,228,454,371.55	61.66
8	其他	-	-
9	合计	2,457,010,043.55	67.99

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110015	石化转债	8,429,820	867,512,776.20	24.00
2	113003	重工转债	3,085,790	326,414,866.20	9.03
3	110013	国投转债	2,190,310	267,195,916.90	7.39
4	110016	川投转债	1,674,520	182,120,795.20	5.04
5	110011	歌华转债	1,473,810	136,636,925.10	3.78

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	799,056.93
2	应收证券清算款	81,892,385.67
3	应收股利	-
4	应收利息	12,675,353.02
5	应收申购款	772,041.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,138,836.71

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110015	石化转债	867,512,776.20	24.00
2	113003	重工转债	326,414,866.20	9.03
3	110013	国投转债	267,195,916.90	7.39
4	110016	川投转债	182,120,795.20	5.04
5	110011	歌华转债	136,636,925.10	3.78
6	110017	中海转债	116,265,708.80	3.22
7	110007	博汇转债	80,741,385.00	2.23
8	110018	国电转债	78,848,000.00	2.18
9	110012	海运转债	66,762,010.00	1.85
10	125731	美丰转债	38,955,098.16	1.08
11	129031	巨轮转 2	24,737,679.15	0.68
12	110003	新钢转债	6,812,127.00	0.19
13	125887	中鼎转债	2,421,014.04	0.07
14	110019	恒丰转债	1,955,933.60	0.05

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
74,127	46,877.38	770,837,046.71	22.18%	2,704,042,469.17	77.82%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人 员持有本基金	4,278,061.89	0.1231%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 10 万份至 50 万份（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年5月11日）基金份额总额	3,282,404,810.93
本报告期期初基金份额总额	3,861,722,014.09
本报告期基金总申购份额	460,994,319.34
减：本报告期基金总赎回份额	847,836,817.55
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,474,879,515.88

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。
- (2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起连续 8 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 10 万元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	1,296,043,264.42	23.97%	1,121,365.99	22.78%	-
光大证券	1	970,360,410.11	17.94%	850,749.96	17.28%	-
申银万国证券	1	909,970,378.20	16.83%	944,753.66	19.19%	-
中金公司	1	805,584,969.42	14.90%	740,306.61	15.04%	-
中银国际证券	1	711,700,420.50	13.16%	603,113.64	12.25%	-
国泰君安证券	1	472,534,919.67	8.74%	442,640.20	8.99%	-

中信建投证券	1	241,596,612.17	4.47%	220,448.40	4.48%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	304,020,477.50	10.81%	30,000,000.00	2.22%	-	-
光大证券	122,230,322.53	4.35%	-	-	-	-
申银万国证券	1,302,488,537.90	46.33%	800,000,000.00	59.18%	-	-
中金公司	527,872,697.90	18.77%	241,900,000.00	17.89%	-	-
中银国际证券	95,909,708.26	3.41%	-	-	-	-
国泰君安证券	352,948,976.50	12.55%	-	-	-	-
中信建投证券	106,155,774.00	3.78%	280,000,000.00	20.71%	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴业全球基金管理有限公司

2013年3月30日