

兴全有机增长灵活配置
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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	兴全有机增长混合
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	1,485,013,391.43 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资于有机增长能力强的公司，获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方法，定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。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。并借鉴海外有机增长的研究成果，构建“兴全有机增长筛选系统”，将有机增

	长投资作为本基金股票组合投资核心理念。
业绩比较基准	中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型证券投资基金，高于可转债、债券型、货币型证券投资基金，属于中高风险、中高收益的证券投资基金品种。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张志永
	联系电话	021-20398888	021-62677777
	电子邮箱	fengxl@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

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	-161,906,088.02	-289,466,620.39	242,267,584.32
本期利润	22,405,636.18	-501,992,892.94	303,035,730.97
加权平均基金份额本期利润	0.0142	-0.2525	0.1689
本期基金份额净值增长率	1.38%	-19.76%	14.42%
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	-0.0357	0.0688	0.2163
期末基金资产净值	1,611,692,865.48	1,799,918,617.84	2,977,231,407.47
期末基金份额净值	1.0853	1.0705	1.3342

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	4.14%	1.04%	5.18%	0.62%	-1.04%	0.42%
过去六个月	-1.49%	1.12%	2.06%	0.60%	-3.55%	0.52%
过去一年	1.38%	1.11%	5.62%	0.62%	-4.24%	0.49%
过去三年	-6.93%	1.16%	-10.15%	0.69%	3.22%	0.47%
自基金合同生效起至今	8.53%	1.10%	10.03%	0.75%	-1.50%	0.35%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中信标普 300 指数选择中国 A 股各行业上市公司中自由流通市值最大、流动性佳且财务稳健的 300 家公司作为样本股，描述了中国 A 股市场的总体趋势。中信标普国债指数是中信证券股份有限公司编制发布的上海证券交易所国债市场基准指数，样本涵盖剩余期限一年以上的所有上交所市场国债（含浮息券），描述了上交所国债市场的总体趋势。

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：

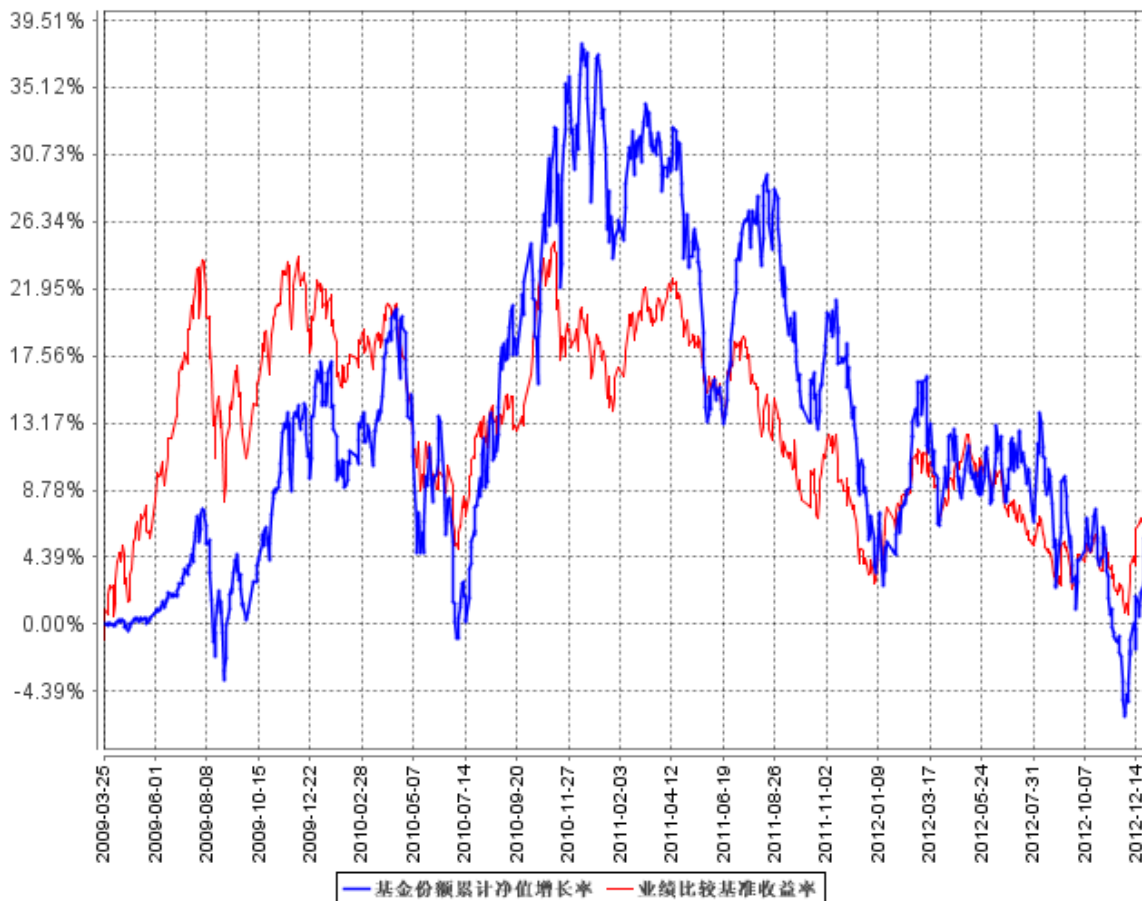
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{中信标普 300 指数}_t / \text{中信标普 300 指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{中信标普国债指数}_t / \text{中信标普国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2009 年 3 月 25 日至 2009 年 9 月 25 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 自基金合同生效以来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

自基金合同生效以来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



注：2009 年数据统计期间为 2009 年 3 月 25 日（基金合同生效之日）至 2009 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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		
陈扬帆	本基金和兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）基金经理	2009 年 3 月 25 日	-	11 年	1971 年生，工商管理硕士，历任北京宏基兴业技术有限公司副总经理，上海奥盛投资有限公司总经理，兴业全球基金管理有限公司兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理助理。

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、《兴全有机增长灵活配置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

一季度各大股指起落和热点转换都很频繁，有机重点抓住了网络视频板块的机会，至三月份中旬弥补了年初的损失，净值也攀升到了+8.6%的收益高点。但由于对周期类股参与力度不足，令整个组合行业间缺乏足够的平衡，在市场热点转换时波动较大。

鉴于指数震荡区间较为狭窄，行情的结构性特征突出，二季度操作上开始尝试“行业集中配置、个股相对突出”的做法。重点投资了安防、装饰园林、消费电子等行业，对于看淡或看不清的行业则采取回避的做法。应该说，集中配置取得了一些积极的成效，但缺点有二：其一，净值

日间波动加大；其二，由于部分持仓流动性缺乏，当需要调整仓位相对困难。

十八大前夕，鉴于市场普遍看空会后，且对政治上的大变动缺乏明确判断，因此我们觉得要考虑会后不跌反而持续上涨的可能，因此并未进行很显著的减仓，并保留了高弹性的电子等板块。结果会后行情先进行了两周的小股票大跌，接着开始了一波大反弹行情，此过程中净值受损较为明显。十一月我们就开始思考为下阶段行情选择能“买得多、拿得住、涨得好”的板块，最后我们决定重配银行股，但实施了一半银行板块即告启动，好在我们此前决心已下，因此该策略最终还是得到了较好的施行。加上十二月有机仓位提升迅速，净值反弹幅度也就较为显著。

操作上，关于集中和均衡是这一年考虑最多的问题，现在我们的结论是：集中也要照顾均衡。实际上，行业、个股均可集中，但如果行业间有互补或者风格板块间有平衡就可以有效减少波动，也更能适应多变的市場。

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 1.38%，同期业绩比较基准收益率 5.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济的弱复苏的迹象较为明显，新的领导集体给市场带来很多期望。但世界经济景气恢复仍不可过高期望，因此大家也担忧国内通胀回升、经济复苏的持续性，但信心已较前期有较大幅度提升。

证券市场有时短看山重水复，长看反而更加清晰——如果我们认真思考二十年中国证券市场在此在未来五到十年中国经济生活最可能被赋予的角色，或许我们的信心也将获得更多的注脚。

短期看银行板块涨幅巨大，存在回调压力。但以长期眼光，银行仍是风险收益比的较好选择；我们关注地产政策的明晰化，并认为这将给房地产板块投资去除不确定性；我们认为安防行业的景气度仍会继续，环保军工作为热点主题也具备其长期逻辑；我们关注白酒尘埃落定之后的投资机会。

我们认为在经济复苏和市场偏暖的背景下，真正的成长股将带来明显的超额收益。我们将致力于“自中而下”的个股投资机会的把握。

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 年以上相关工作经验，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》、《兴全有机增长灵活配置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，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

本托管人依据《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》与《兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》，自 2009 年 3 月 25 日起托管兴业有机增长灵活配置（即更名后的“兴全有机增长灵活配置”）混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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_B06 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：兴全有机增长灵活配置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		304,652,241.17	212,235,510.94
结算备付金		3,825,628.07	7,780,876.75
存出保证金		1,500,000.00	1,278,723.45
交易性金融资产		1,324,604,556.37	1,310,082,977.10
其中：股票投资		1,243,327,489.17	1,001,919,055.30
基金投资		-	-
债券投资		81,277,067.20	308,163,921.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	299,000,768.50
应收证券清算款		6,384,433.01	-
应收利息		510,659.49	2,134,527.92
应收股利		-	-
应收申购款		241,061.21	24,148,145.02
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,641,718,579.32	1,856,661,529.68
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		21,626,112.61	50,049,008.10
应付赎回款		2,228,634.41	864,849.70
应付管理人报酬		1,885,832.26	2,347,868.36
应付托管费		314,305.35	391,311.40
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		2,267,036.70	1,988,383.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,703,792.51	1,101,490.84
负债合计		30,025,713.84	56,742,911.84
所有者权益：			
实收基金		1,485,013,391.43	1,681,342,221.28
未分配利润		126,679,474.05	118,576,396.56
所有者权益合计		1,611,692,865.48	1,799,918,617.84
负债和所有者权益总计		1,641,718,579.32	1,856,661,529.68

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0853 元，基金份额总额 1,485,013,391.43 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全有机增长灵活配置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		72,670,842.78	-436,990,136.76
1. 利息收入		12,001,970.84	12,724,989.14
其中：存款利息收入		5,197,364.27	3,420,232.60
债券利息收入		3,517,185.33	3,811,382.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,287,421.24	5,493,374.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-124,236,873.08	-238,613,812.08
其中：股票投资收益		-138,462,899.63	-248,242,507.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益		6,017,480.03	96,485.81
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益		8,208,546.52	9,532,209.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		184,311,724.20	-212,526,272.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		594,020.82	1,424,958.73
减：二、费用		50,265,206.60	65,002,756.18
1. 管理人报酬		25,488,344.68	36,927,717.33
2. 托管费		4,248,057.33	6,154,619.54
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		20,201,962.82	21,453,328.64
5. 利息支出		-	132,120.41
其中：卖出回购金融资产支出		-	132,120.41
6. 其他费用		326,841.77	334,970.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,405,636.18	-501,992,892.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,405,636.18	-501,992,892.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全有机增长灵活配置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）	1,681,342,221.28	118,576,396.56	1,799,918,617.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	22,405,636.18	22,405,636.18
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）	-196,328,829.85	-14,302,558.69	-210,631,388.54
其中：1. 基金申购款	472,297,972.54	38,376,545.43	510,674,517.97
2. 基金赎回款	-668,626,802.39	-52,679,104.12	-721,305,906.51
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	1,485,013,391.43	126,679,474.05	1,611,692,865.48

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
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	2,231,513,507.21	745,717,900.26	2,977,231,407.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-501,992,892.94	-501,992,892.94
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）	-550,171,285.93	-125,148,610.76	-675,319,896.69
其中：1. 基金申购款	636,686,234.24	157,117,392.93	793,803,627.17
2. 基金赎回款	-1,186,857,520.17	-282,266,003.69	-1,469,123,523.86
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）	1,681,342,221.28	118,576,396.56	1,799,918,617.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

兰荣

杨东

詹鸿飞

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金（原名兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金）（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]1395号文《关于核准兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准，由兴业全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于2009年3月25日正式生效，首次设立募集规模为1,980,254,871.35份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于2010年1月1日起更名为兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会

批准允许基金投资的其它金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数×50%+中信标普国债指数×45%+同业存款利率×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告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

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的管理费	25,488,344.68	36,927,717.33
其中：支付销售机构的客户维护费	3,052,278.16	3,811,709.06

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 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×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	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	4,248,057.33	6,154,619.54

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

本基金本报告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	上年度可比期间
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	43,426,060.93
期间申购/买入总份额	40,355,713.82	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	43,426,060.93
期末持有的基金份额	40,355,713.82	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.72%	-

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投资本基金。

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
兴业银行	304,652,241.17	5,081,603.00	212,235,510.94	3,304,805.64

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金本报告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

本基金本报告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	1,243,327,489.17	75.73
	其中：股票	1,243,327,489.17	75.73
2	固定收益投资	81,277,067.20	4.95
	其中：债券	81,277,067.20	4.95
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	308,477,869.24	18.79
6	其他各项资产	8,636,153.71	0.53
7	合计	1,641,718,579.32	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	-	-
B	采掘业	39,111,588.57	2.43
C	制造业	407,342,367.23	25.27
C0	食品、饮料	162,436,309.27	10.08
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	-	-
C5	电子	61,261,825.94	3.80
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	117,107,872.02	7.27

C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	66,536,360.00	4.13
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	40,270,383.59	2.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	109,502,521.14	6.79
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	343,117,556.03	21.29
J	房地产业	230,469,794.61	14.30
K	社会服务业	48,145,308.48	2.99
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	25,367,969.52	1.57
	合计	1,243,327,489.17	77.14

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	600016	民生银行	13,300,278	104,540,185.08	6.49
2	600036	招商银行	7,206,381	99,087,738.75	6.15
3	000799	酒鬼酒	3,005,322	98,574,561.60	6.12
4	002594	比亚迪	3,269,600	66,536,360.00	4.13
5	600587	新华医疗	2,004,502	62,360,057.22	3.87
6	600702	沱牌舍得	1,805,527	52,017,232.87	3.23
7	600000	浦发银行	5,000,000	49,600,000.00	3.08
8	002672	东江环保	806,184	48,145,308.48	2.99
9	002421	达实智能	2,458,225	41,421,091.25	2.57
10	600048	保利地产	3,003,081	40,841,901.60	2.53

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	600016	民生银行	278,746,246.51	15.49
2	600036	招商银行	152,577,607.80	8.48

3	002310	东方园林	127,956,972.37	7.11
4	600111	包钢稀土	127,711,989.73	7.10
5	600702	沱牌舍得	124,516,783.02	6.92
6	000799	酒鬼酒	122,679,239.12	6.82
7	600060	海信电器	118,368,054.06	6.58
8	000537	广宇发展	116,888,277.05	6.49
9	600088	中视传媒	113,787,458.63	6.32
10	002375	亚厦股份	113,678,973.74	6.32
11	002482	广田股份	111,965,096.40	6.22
12	300017	网宿科技	108,080,059.23	6.00
13	600048	保利地产	107,310,035.10	5.96
14	002415	海康威视	106,185,482.65	5.90
15	601169	北京银行	104,361,066.10	5.80
16	002236	大华股份	101,617,172.07	5.65
17	600703	三安光电	97,766,964.95	5.43
18	300197	铁汉生态	93,885,345.54	5.22
19	000937	冀中能源	87,214,446.93	4.85
20	000100	TCL 集团	81,532,200.00	4.53
21	002594	比亚迪	74,724,937.49	4.15
22	002273	水晶光电	74,274,339.19	4.13
23	002638	勤上光电	71,446,724.18	3.97
24	600549	厦门钨业	70,576,751.87	3.92
25	600085	同仁堂	68,415,267.61	3.80
26	600123	兰花科创	68,402,764.13	3.80
27	300251	光线传媒	68,367,953.94	3.80
28	603000	人民网	63,160,851.67	3.51
29	600000	浦发银行	62,067,711.44	3.45
30	600383	金地集团	61,374,572.40	3.41
31	000522	白云山 A	61,266,915.30	3.40
32	000402	金融街	60,994,178.95	3.39
33	600587	新华医疗	60,264,401.45	3.35
34	002431	棕榈园林	59,111,450.88	3.28
35	002353	杰瑞股份	58,078,503.04	3.23
36	000527	美的电器	57,966,707.76	3.22
37	600316	洪都航空	54,920,905.41	3.05
38	600376	首开股份	54,896,821.87	3.05

39	600260	凯乐科技	54,324,594.53	3.02
40	300027	华谊兄弟	53,962,025.96	3.00
41	002340	格林美	53,048,526.41	2.95
42	600015	华夏银行	51,529,896.25	2.86
43	603001	奥康国际	50,756,853.72	2.82
44	300128	锦富新材	50,399,510.81	2.80
45	600199	金种子酒	49,941,934.69	2.77
46	002244	滨江集团	49,301,965.63	2.74
47	600240	华业地产	49,093,312.10	2.73
48	601336	新华保险	48,979,411.28	2.72
49	002672	东江环保	47,717,683.26	2.65
50	600223	鲁商置业	46,918,546.24	2.61
51	600276	恒瑞医药	46,886,846.77	2.60
52	600831	广电网络	46,883,934.39	2.60
53	600340	华夏幸福	46,739,199.78	2.60
54	600673	东阳光铝	44,828,869.84	2.49
55	002161	远望谷	43,360,249.48	2.41
56	000686	东北证券	42,064,838.16	2.34
57	600332	广州药业	41,516,668.69	2.31
58	600535	天士力	41,377,833.77	2.30
59	600208	新潮中宝	41,093,165.44	2.28
60	002106	莱宝高科	40,942,845.40	2.27
61	300273	和佳股份	40,731,209.65	2.26
62	601699	潞安环能	40,040,507.84	2.22
63	002421	达实智能	39,926,798.19	2.22
64	601933	永辉超市	39,823,575.84	2.21
65	600750	江中药业	39,074,265.35	2.17
66	000783	长江证券	38,660,001.89	2.15
67	000848	承德露露	38,051,650.09	2.11
68	002241	歌尔声学	37,757,434.23	2.10
69	600970	中材国际	37,046,355.30	2.06
70	600742	一汽富维	36,953,522.58	2.05
71	002005	德豪润达	36,939,366.58	2.05
72	601901	方正证券	36,455,526.13	2.03

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	600016	民生银行	190,747,741.99	10.60
2	600637	百视通	158,277,223.14	8.79
3	600111	包钢稀土	129,835,078.76	7.21
4	600088	中视传媒	128,575,208.46	7.14
5	002236	大华股份	124,392,341.25	6.91
6	600060	海信电器	124,331,052.43	6.91
7	002310	东方园林	123,713,067.35	6.87
8	600519	贵州茅台	118,995,199.60	6.61
9	002415	海康威视	115,760,504.98	6.43
10	601169	北京银行	105,201,847.53	5.84
11	002375	亚厦股份	104,024,824.59	5.78
12	000858	五粮液	101,864,498.34	5.66
13	000537	广宇发展	97,776,183.21	5.43
14	600703	三安光电	96,518,916.05	5.36
15	000776	广发证券	95,992,990.20	5.33
16	300197	铁汉生态	89,724,637.43	4.98
17	002024	苏宁电器	87,554,458.88	4.86
18	300017	网宿科技	87,538,645.68	4.86
19	000100	TCL 集团	81,788,839.99	4.54
20	002482	广田股份	81,779,635.18	4.54
21	300146	汤臣倍健	79,156,637.53	4.40
22	600549	厦门钨业	76,910,724.03	4.27
23	600742	一汽富维	76,692,354.94	4.26
24	600702	沱牌舍得	76,247,852.75	4.24
25	600123	兰花科创	76,126,588.31	4.23
26	300251	光线传媒	73,073,984.00	4.06
27	002273	水晶光电	72,365,467.39	4.02
28	600048	保利地产	71,576,534.43	3.98
29	002594	比亚迪	71,389,181.78	3.97
30	002638	勤上光电	70,612,916.16	3.92
31	600085	同仁堂	69,351,543.50	3.85
32	000937	冀中能源	67,475,314.96	3.75
33	600036	招商银行	65,768,532.75	3.65
34	002353	杰瑞股份	60,696,309.38	3.37

35	600383	金地集团	60,223,301.75	3.35
36	000527	美的电器	59,367,155.92	3.30
37	002431	棕榈园林	57,193,330.65	3.18
38	000522	白云山A	54,732,305.55	3.04
39	002340	格林美	54,437,861.36	3.02
40	300027	华谊兄弟	54,034,034.65	3.00
41	603001	奥康国际	52,978,722.37	2.94
42	300128	锦富新材	52,520,740.74	2.92
43	600260	凯乐科技	52,378,057.62	2.91
44	600240	华业地产	51,001,290.21	2.83
45	000598	兴蓉投资	50,126,579.78	2.78
46	601336	新华保险	48,530,998.14	2.70
47	600199	金种子酒	44,973,854.64	2.50
48	600208	新湖中宝	43,653,805.95	2.43
49	600831	广电网络	43,616,182.77	2.42
50	600276	恒瑞医药	43,247,248.45	2.40
51	000402	金融街	43,121,375.35	2.40
52	603000	人民网	41,865,306.84	2.33
53	000686	东北证券	41,765,957.69	2.32
54	600673	东阳光铝	41,280,291.59	2.29
55	600535	天士力	41,090,779.19	2.28
56	002161	远望谷	40,993,169.46	2.28
57	600223	鲁商置业	38,334,814.63	2.13
58	000848	承德露露	38,242,100.93	2.12
59	000732	泰禾集团	37,968,490.25	2.11
60	002241	歌尔声学	37,796,069.11	2.10
61	600157	永泰能源	37,211,118.36	2.07
62	000783	长江证券	37,106,596.53	2.06
63	601699	潞安环能	37,089,760.99	2.06
64	002646	青青稞酒	36,645,834.43	2.04
65	600340	华夏幸福	36,616,126.48	2.03

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	7,364,894,692.95
卖出股票收入（成交）总额	7,171,075,044.07

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	69,474,000.00	4.31
2	央行票据	9,982,000.00	0.62
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,821,067.20	0.11
8	其他	-	-
9	合计	81,277,067.20	5.04

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	129908	12 贴现国债 08	500,000	49,620,000.00	3.08
2	129907	12 贴现国债 07	200,000	19,854,000.00	1.23
3	1001079	10 央票 79	100,000	9,982,000.00	0.62
4	110022	同仁转债	15,570	1,821,067.20	0.11

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	1,500,000.00
2	应收证券清算款	6,384,433.01
3	应收股利	-
4	应收利息	510,659.49
5	应收申购款	241,061.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,636,153.71

8.9.4 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。

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
35,470	41,866.74	685,313,522.92	46.15%	799,699,868.51	53.85%

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	2,934,799.02	0.1976%

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 50 万份至 100 万份（含）。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 50 万份至 100 万份（含）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年3月25日）基金份额总额	1,980,254,871.35
本报告期期初基金份额总额	1,681,342,221.28
本报告期基金总申购份额	472,297,972.54
减：本报告期基金总赎回份额	668,626,802.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,485,013,391.43

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 4 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	
长江证券	1	4,414,413,087.59	30.67%	2,919,598.33	27.23%	-
渤海证券	1	1,763,008,597.79	12.25%	1,514,283.28	14.12%	-
招商证券	1	1,628,257,118.71	11.31%	1,328,391.15	12.39%	-
德邦证券	1	1,092,661,168.27	7.59%	940,247.32	8.77%	-
湘财证券	2	1,055,713,999.51	7.34%	869,633.38	8.11%	-
华泰证券	1	882,813,581.73	6.13%	593,363.95	5.53%	-
海通证券	1	560,507,966.23	3.89%	398,182.75	3.71%	-
华创证券	1	492,708,194.11	3.42%	419,267.35	3.91%	-
齐鲁证券	1	462,474,884.08	3.21%	305,015.48	2.84%	-
信达证券	1	440,431,129.62	3.06%	312,881.90	2.92%	-
宏源证券	1	425,346,976.42	2.96%	260,526.29	2.43%	-
东方证券	1	420,186,470.58	2.92%	282,936.11	2.64%	-
中航证券	1	404,308,875.11	2.81%	269,503.51	2.51%	-
华融证券	2	225,138,981.50	1.56%	197,705.97	1.84%	-
第一创业	1	124,800,359.77	0.87%	110,644.09	1.03%	-

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	70,604,675.40	42.12%	250,000,000.00	15.82%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	1,652,431.00	0.99%	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,008,350.00	0.60%	250,000,000.00	15.82%	-	-
海通证券	-	-	580,700,000.00	36.74%	-	-
华创证券	52,047,427.50	31.05%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	19,766,417.40	11.79%	300,000,000.00	18.98%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	22,530,905.50	13.44%	-	-	-	-
华融证券	-	-	200,000,000.00	12.65%	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-

§ 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