

兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）

2013 年第 3 季度报告

2013 年 9 月 30 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

报告送出日期：2013 年 10 月 25 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 10 月 24 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 2013 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资股票（LOF）
基金场内简称	兴全绿色
基金主代码	163409
交易代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 5 月 6 日
报告期末基金份额总额	1,052,193,562.12 份
投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，力争实现当期投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在大类资产配置上，采取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。在运用“绿色投资筛选策略”的基础上，采用环境因子与公司财务等基本面因子相结合，进行综合评估筛选，对那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，属于较高预期风险、较高

	预期收益的基金品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2013年7月1日—2013年9月30日）
1. 本期已实现收益	99,344,125.32
2. 本期利润	251,211,439.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2243
4. 期末基金资产净值	1,322,045,873.64
5. 期末基金份额净值	1.256

注：1、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。

2、所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：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。

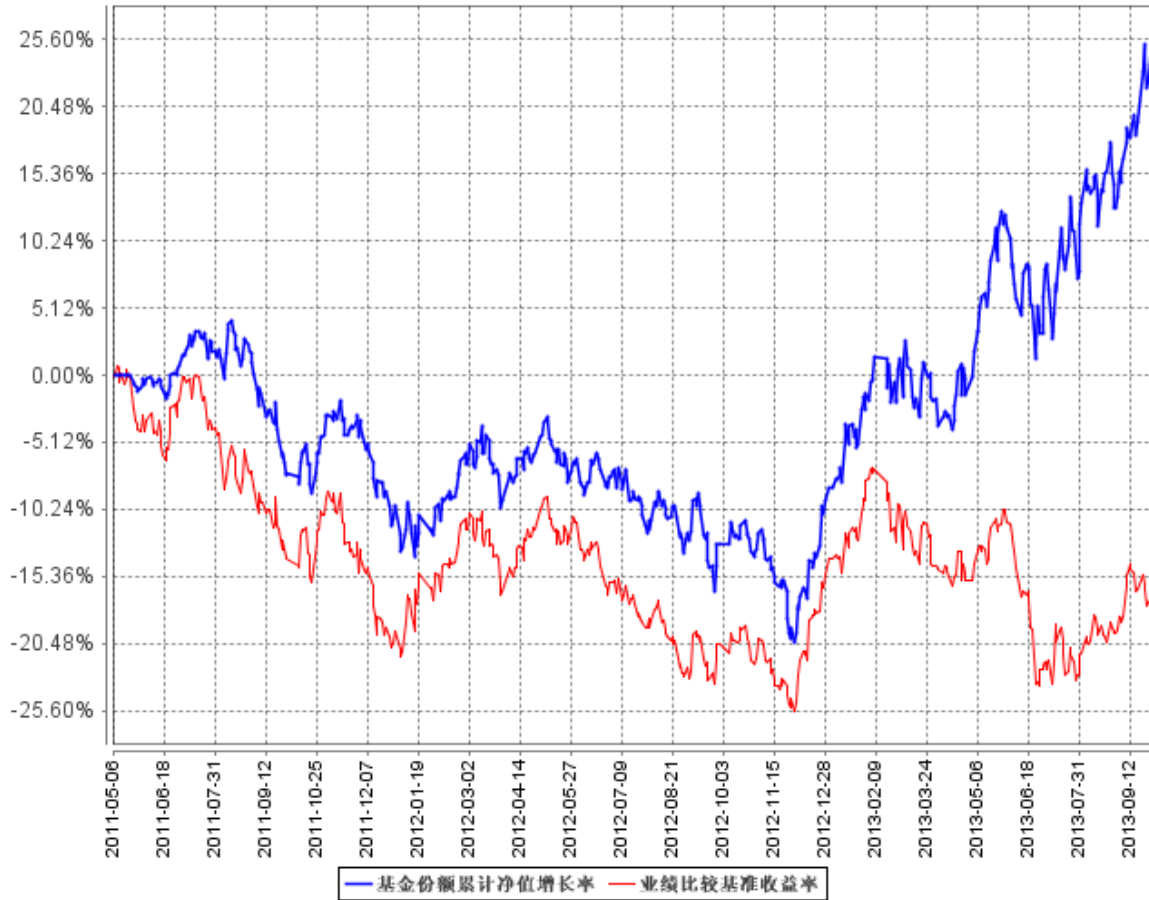
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	21.71%	1.48%	7.22%	1.14%	14.49%	0.34%

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

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 2013 年 9 月 30 日。

2、按照《兴全绿色投资股票型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定，本基金建仓期为 2011 年 5 月 6 日至 2011 年 8 月 5 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。

§ 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈锦泉	本基金基金经理	2011 年 5 月 6 日	-	14 年	1977 年生，工商管理硕士。历任职华安证券 (原名为安徽证券) 证券投资总部投资经理，平安保险资产运营中

					心高级组合经理，平安资产管理公司投资管理部副总经理。
--	--	--	--	--	----------------------------

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、《兴全绿色投资股票型证券投资基金（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 公平交易专项说明

4.3.1 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。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

半年报说到“因宏观经济二次探底，投资前景低迷，资金从过剩产能行业的撤出，乐观预见资本市场会出现流动性偏正面的情景”，尽管做判断时底气不足，但是从三季度沪深 300 和创业板都出现了指数上涨和成交活跃的表现看，这个判断总体正确。三季度，代表未来的新兴产业以及自贸区相关股票表现优异。本基金持有的自动化装备、移动互联网、智能医疗、医疗器械和光伏等板块表现良好，为基金带来了不错的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 21.71%，同期业绩比较基准收益率为 7.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年创业板是牛市，沪深 300 是平衡市，大局基本改变不了了。今年主题投资盛行、局部泡沫的特点非常明显，尽管流动性充裕能够解释部分因素，但是我们必须清醒地看到其中部分的投机和泡沫成分。展望四季度，我们认为对市场存在回归理性的可能，但是在整个经济转型的大背景下，那些代表经济转型发展方向的行业和具有创新能力的公司会穿越周期，因此对调整的过度担忧同样是不可取的。本基金管理人目前的主要策略是逐渐为明年进行布局，侧重未来成长，选股不必拘泥于行业。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,171,411,510.36	87.50
	其中：股票	1,171,411,510.36	87.50
2	固定收益投资	73,716,966.00	5.51
	其中：债券	73,716,966.00	5.51
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,000.00	3.73
	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	36,109,792.16	2.70
6	其他资产	7,536,897.22	0.56
7	合计	1,338,775,165.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	828,594,216.04	62.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	40,004,754.80	3.03
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	124,849,863.83	9.44
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	88,246,450.86	6.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,425,000.00	2.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	48,791,224.83	3.69
N	水利、环境和公共设施管理业	14,500,000.00	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,171,411,510.36	88.61

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002024	苏宁云商	8,620,419	110,772,384.15	8.38
2	300124	汇川技术	1,958,870	97,688,846.90	7.39
3	600835	上海机电	4,600,000	72,910,000.00	5.51
4	600872	中炬高新	5,777,436	57,889,908.72	4.38
5	002308	威创股份	5,890,307	54,603,145.89	4.13
6	300012	华测检测	2,848,291	48,791,224.83	3.69
7	601126	四方股份	2,633,718	48,355,062.48	3.66
8	600089	特变电工	3,789,988	45,745,155.16	3.46
9	300289	利德曼	1,239,567	42,455,169.75	3.21
10	002202	金风科技	5,559,998	39,031,185.96	2.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	54,346,966.00	4.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,370,000.00	1.47
	其中：政策性金融债	19,370,000.00	1.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	73,716,966.00	5.58

5.5 报告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

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	130007	13 付息国债 07	400,000	39,836,000.00	3.01
2	130205	13 国开 05	200,000	19,370,000.00	1.47
3	130014	13 付息国债 14	100,000	10,002,000.00	0.76
4	010303	03 国债(3)	46,900	4,508,966.00	0.34

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1,154,155.24
2	应收证券清算款	4,440,029.53
3	应收股利	-
4	应收利息	1,304,402.88
5	应收申购款	638,309.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,536,897.22

5.10.4 报告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可转换债券。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,206,856,723.46
报告期期间基金总申购份额	37,469,336.09
减：报告期期间基金总赎回份额	192,132,497.43
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,052,193,562.12

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

本基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xyfunds.com.cn>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

兴全全球基金管理有限公司

2013 年 10 月 25 日