

2012 年第三季度公司旗下基金产品风险评价

根据《兴业全球基金管理有限公司基金销售适用性管理制度》与《公司旗下基金产品风险评价方法说明》中关于公司旗下基金产品风险评价的具体要求，以 2012 年第三季度各基金产品相关指标为主要参照，进行基金产品的风险评价。

一、兴全可转债基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

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。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、国债，以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。

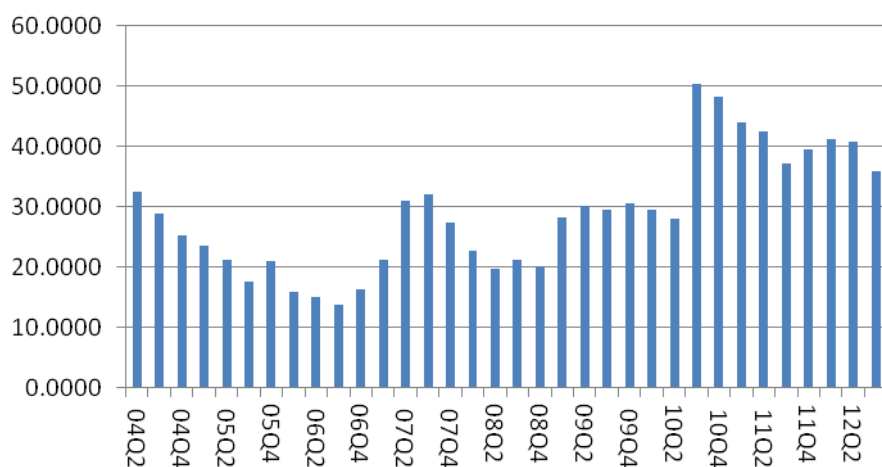
可转债 30%~95%（其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于 50%），股票不高于 30%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、2012 年第三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	620,954,093.76	17.23
	其中：股票	620,954,093.76	17.23
2	固定收益投资	2,834,641,973.03	78.67
	其中：债券	2,834,641,973.03	78.67
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,275.00	1.39
	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	33,814,957.93	0.94
6	其他资产	64,008,396.01	1.78
7	合计	3,603,419,695.73	100.00

3、本基金历史规模

兴全可转债历史规模（亿）



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全可转债	2.4016	6.475	1.6746	4.2404	-0.3452	-0.0084	-4.9845	-0.1221

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	-0.33%	0.46%	-0.52%	0.45%	0.19%	0.01%
过去三个月 2012.07.01-2012.09.30	-4.37%	0.39%	-3.51%	0.34%	-0.86%	0.05%
过去六个月 2012.04.01-2012.09.30	-2.45%	0.41%	-2.08%	0.36%	-0.37%	0.05%
今年以来 2012.01.01-2012.09.30	-1.64%	0.48%	-0.81%	0.44%	-0.83%	0.04%
过去一年 2011.10.01-2012.09.30	-1.01%	0.52%	2.04%	0.51%	-3.05%	0.01%
过去二年 2010.10.01-2012.09.30	-11.5%	0.58%	-11.06%	0.62%	-0.44%	-0.04%
过去三年 2009.10.01-2012.09.30	0.11%	0.59%	-14.67%	0.68%	14.78%	-0.09%

过去四年 2008. 10. 01-2012. 09. 30	22. 18%	0. 63%	1. 26%	0. 93%	20. 92%	-0. 30%
过去五年 2007. 10. 01-2012. 09. 30	-2. 75%	0. 71%	-47. 86%	1. 04%	45. 11%	-0. 33%
自成立以来 2004. 05. 11-2012. 09. 30	279. 58%	0. 75%	86. 33%	1. 02%	193. 25%	-0. 27%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：中等风险

二、兴全趋势投资基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益，增加投资组合收益的确定性和稳定性；充分享受中国上市公司高速成长带来的资本增值；减少决策的失误率，实现最优化的风险调整后的投资收益。

本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券(包括各种债券和货币市场工具)以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

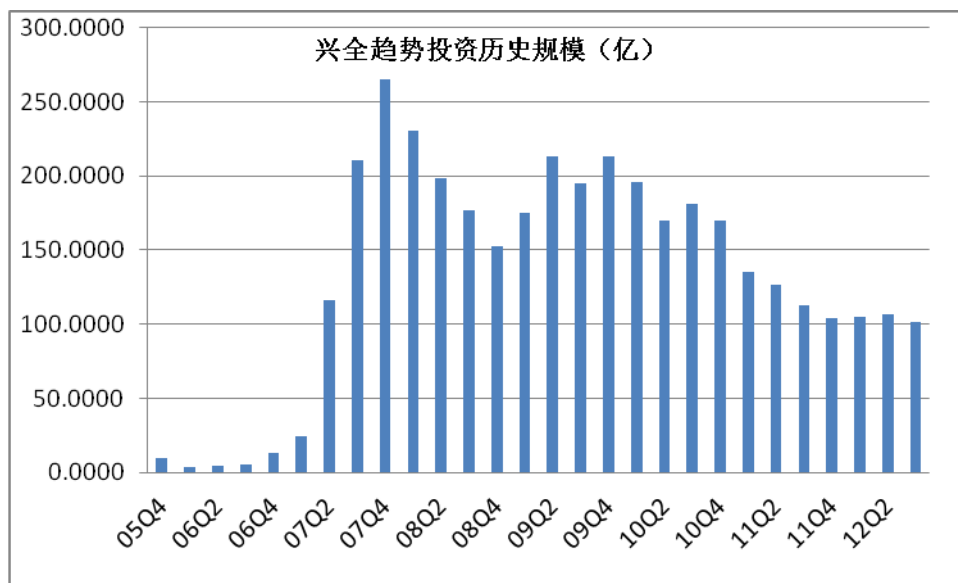
本基金为灵活配置型基金，投资组合范围为：股票 30%—95%，固定收益证券 0%—65%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不少于 5%。本基金的股票投资将集中于通过兴业多维趋势分析系统选择出来的上市公司。固定收益类证券的投资比重为 0—65%，股票的投资比重为 30%—95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。法律法规另有规定时，从其规定。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6, 859, 336, 389. 34	67. 52
	其中：股票	6, 859, 336, 389. 34	67. 52
2	固定收益投资	1, 265, 989, 440. 04	12. 46
	其中：债券	1, 265, 989, 440. 04	12. 46
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	494, 700, 942. 05	4. 87

	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	1,510,456,544.47	14.87
6	其他资产	27,921,897.41	0.27
7	合计	10,158,405,213.31	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全趋势投资	-8.1187	-7.2254	0.8365	0.8025	1.6747	0.0159	-5.6240	-0.0527

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	2.38%	0.99%	2.03%	0.78%	0.35%	0.21%
过去三个月 2012.07.01-2012.09.30	-4.07%	0.79%	-2.96%	0.58%	-1.11%	0.21%
过去六个月 2012.04.01-2012.09.30	-1.13%	0.75%	-2.18%	0.56%	1.05%	0.19%

今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	-0. 22%	0. 86%	0. 42%	0. 62%	-0. 64%	0. 24%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	-4. 39%	0. 87%	-3. 28%	0. 64%	-1. 11%	0. 23%
过去二年 2010. 10. 01-2012. 09. 30	-13. 20%	0. 95%	-8. 45%	0. 67%	-4. 75%	0. 28%
过去三年 2009. 10. 01-2012. 09. 30	-7. 57%	1. 02%	-6. 19%	0. 71%	-1. 38%	0. 31%
过去四年 2008. 10. 01-2012. 09. 30	21. 36%	1. 16%	12. 93%	0. 85%	8. 43%	0. 31%
过去五年 2007. 10. 01-2012. 09. 30	-18. 50%	1. 26%	-23. 53%	0. 99%	5. 03%	0. 27%
自成立以来 2005. 11. 03-2012. 09. 30	434. 71%	1. 31%	98. 60%	0. 97%	336. 11%	0. 34%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

本基金在 2007 年曾参加了股票“三房巷”公开增发的网上申购，事后得知“三房巷”增发是由本基金管理人控股股东兴业证券股份有限公司担任主承销商的。此次申购未对本基金资产造成损失。除此之外，该基金均无任何违规行为。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》中“投资于股票、债券以及货币市场工具的基金，且不符合股票型和债券型基金的分类标准；且股票投资比例为 30%—80%。如果连续两个季度股票投资比例 $\geq 60\%$ ，则上调风险等级”的说明，兴全趋势基金的股票投资比例连续两个季度均高于 60%，其中 2012 年二季度、2012 年三季度该基金股票投资比例分别为：74. 5%、67. 52%，结合上述指标给予该基金的风险等级：高风险。

三、兴全全球视野基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金以全球视野的角度，主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司，追求当期收益实现与长期资本增值。

本基金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、回购、央行票据、可转换债券、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。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当

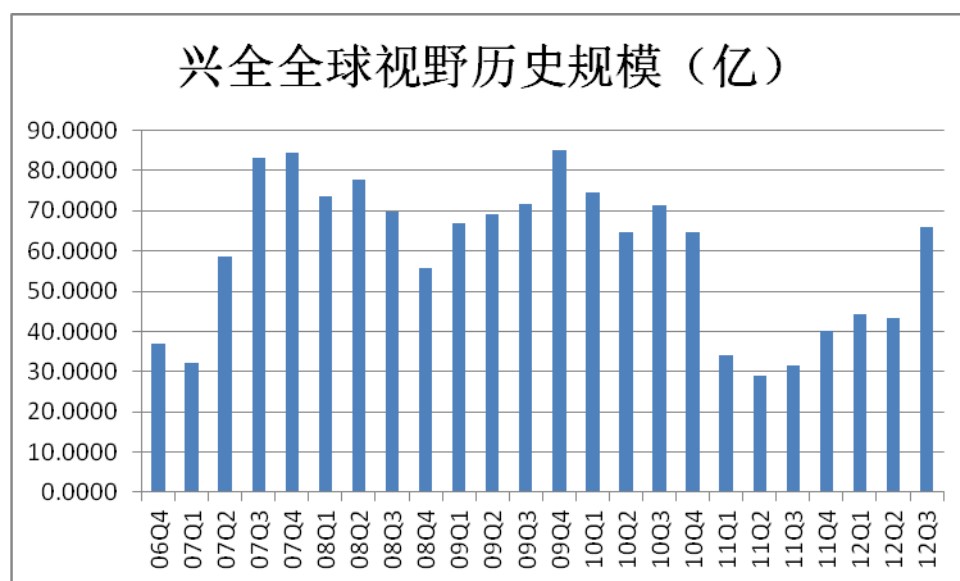
程序后, 可以将其纳入投资范围。

在正常的市场情况下, 本基金的股票投资比例为 65%-95%、债券投资比例为 0%-30%、权证投资比例为 0-3%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于 5%。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。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例:

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,505,975,199.72	81.49
	其中: 股票	5,505,975,199.72	81.49
2	固定收益投资	418,275,189.00	6.19
	其中: 债券	418,275,189.00	6.19
	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	824,156,913.69	12.20
6	其他资产	8,325,114.67	0.12
7	合计	6,756,732,417.08	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全全球视野	8.7068	27.6791	4.1497	10.3322	-0.9217	-0.0208	22.6511	0.5220

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	0.89%	0.91%	3.13%	1.25%	-2.24%	-0.34%
过去三个月 2012.07.01-2012.09.30	-4.46%	0.74%	-5.18%	0.93%	0.72%	-0.19%
过去六个月 2012.04.01-2012.09.30	-3.09%	0.73%	-4.67%	0.90%	1.58%	-0.17%
今年以来 2012.01.01-2012.09.30	-0.49%	0.88%	-1.18%	1.00%	0.69%	-0.12%
过去一年 2011.10.01-2012.09.30	-4.29%	0.93%	-7.89%	1.03%	3.60%	-0.10%
过去二年 2010.10.01-2012.09.30	-7.79%	1.07%	-17.07%	1.07%	9.28%	0.00%
过去三年 2009.10.01-2012.09.30	4.39%	1.12%	-16.39%	1.14%	20.78%	-0.02%
过去四年 2008.10.01-2012.09.30	39.71%	1.27%	7.68%	1.37%	32.03%	-0.10%
过去五年 2007.10.01-2012.09.30	-12.07%	1.41%	-45.39%	1.58%	33.32%	-0.17%
自成立以来 2006.09.20-2012.09.30	216.44%	1.49%	65.74%	1.61%	150.70%	-0.12%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：高风险

四、兴全社会责任基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值，同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。

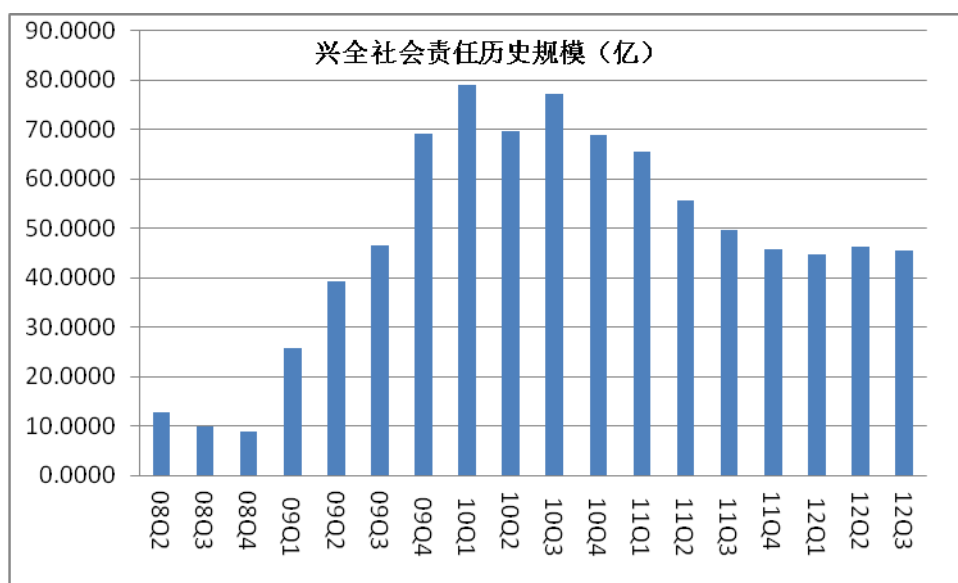
本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在正常的市场情况下，各类资产的投资比例为：股票投资比例为 65%-95%；债券投资比例为 0%-30%；资产支持证券占 0%-20%；权证投资比例为 0—3%；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%。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。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,879,679,571.01	84.52
	其中：股票	3,879,679,571.01	84.52
2	固定收益投资	217,281,120.00	4.73
	其中：债券	217,281,120.00	4.73
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	200,000,000.00	4.36
	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	78,682,783.31	1.71
6	其他资产	214,747,163.89	4.68
7	合计	4,590,390,638.21	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全社会责任	-4.127 2	-8.289 4	-0.928 3	-2.032 9	1.6284	0.0364	-0.755 2	-0.016 3

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	3.55%	1.21%	3.14%	1.25%	0.41%	-0.04%
过去三个月 2012.07.01-2012.09.30	-1.93%	1.08%	-5.15%	0.93%	3.22%	0.15%
过去六个月 2012.04.01-2012.09.30	2.28%	1.00%	-4.60%	0.90%	6.88%	0.10%
今年以来 2012.01.01-2012.09.30	3.27%	1.13%	-1.07%	1.00%	4.34%	0.13%
过去一年 2011.10.01-2012.09.30	-4.50%	1.16%	-7.73%	1.03%	3.23%	0.13%
过去二年 2010.10.01-2012.09.30	-17.16%	1.16%	-16.88%	1.07%	-0.28%	0.09%

过去三年 2009.10.01-2012.09.30	-1.49%	1.21%	-16.05%	1.14%	14.56%	0.07%
过去四年 2008.10.01-2012.09.30	58.82%	1.36%	8.33%	1.37%	50.49%	-0.01%

截止日期：2012年9月30日

5、基金成立以来有无违规行为

本基金在2008年曾发生过投资托管人股票的情况，基金管理人及时发现，予以调整，并已向监管部门报告。该投资行为未对基金资产造成损失。除此之外，该基金均无任何违规行为。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：高风险

五、兴全货币市场基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上，使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等，使基金收益达到同期货币市场的收益水平，力争超越业绩比较基准。

现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行存款、剩余期限在397天以内（含397天）的债券，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、短期融资券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

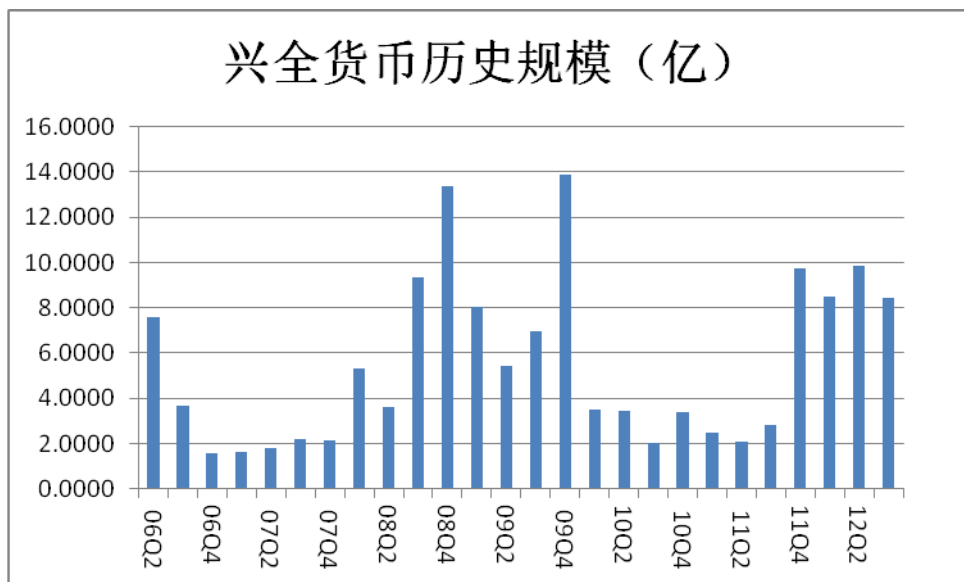
投资决策委员会定期召开会议，并依据基金管理部、研究部的报告确定基金资产配置的比例；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议作出决策。

2、2012年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	320,574,082.33	37.95
	其中：债券	320,574,082.33	37.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

3	银行存款和结算备付金合计	515,886,790.67	61.07
4	其他资产	8,312,618.76	0.98
5	合计	844,773,491.76	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全货币	6.9074	245.3907	-1.2495	-12.8523	1.3704	0.1617	-1.4197	-0.1442

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012. 09. 01-2012. 09. 30	0.2408%	0.0022%	0.2301%	0.0000%	0.0107%	0.0022%
过去三个月 2012. 07. 01-2012. 09. 30	0.8218%	0.0028%	0.7092%	0.0002%	0.1126%	0.0026%
过去六个月 2012. 04. 01-2012. 09. 30	1.8301%	0.0030%	1.5162%	0.0006%	0.3139%	0.0024%
今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	13.7491%	0.0060%	13.4668%	0.0019%	0.2823%	0.0041%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	4.2226%	0.0038%	3.1707%	0.0006%	1.0519%	0.0032%

过去三年 2009. 10. 01-2012. 09. 30	8. 0498%	0. 0045 %	7. 7226%	0. 0017 %	0. 3272 %	0. 0028 %
过去五年 2007. 10. 01-2012. 09. 30	13. 7491 %	0. 0060 %	13. 4668 %	0. 0019 %	0. 2823 %	0. 0041 %
成立以来 2006. 4. 26-2012. 9. 30	17. 5747 %	0. 0059 %	16. 2646 %	0. 0019 %	1. 3101 %	0. 0040 %

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：低风险

六、兴全有机增长混合型基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

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。

本基金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%。

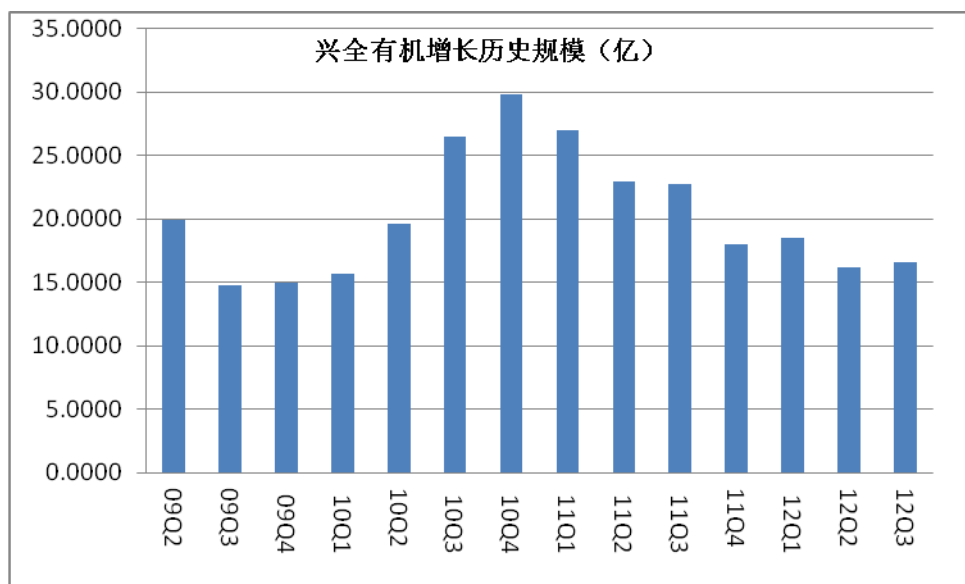
如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1, 030, 361, 572. 37	61. 82
	其中：股票	1, 030, 361, 572. 37	61. 82
2	固定收益投资	96, 670, 000. 00	5. 80
	其中：债券	96, 670, 000. 00	5. 80
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	100,000,350.00	6.00
	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	334,492,315.64	20.07
6	其他资产	105,225,686.80	6.31
7	合计	1,666,749,924.81	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度 规模变化		2012 一季度 规模变化		2012 二季度 规模变化		2012 三季度 规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全有机增长	-4.7413	-20.8495	0.5189	2.8828	-2.3507	-0.1269	0.4324	0.0267

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	1.66%	1.33%	2.03%	0.78%	-0.37%	0.55%

过去三个月 2012. 07. 01-2012. 09. 30	-5. 40%	1. 18%	-2. 96%	0. 58%	-2. 44%	0. 60%
过去六个月 2012. 04. 01-2012. 09. 30	-2. 45%	1. 10%	-2. 18%	0. 56%	-0. 27%	0. 54%
今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	-2. 64%	1. 13%	0. 42%	0. 62%	-3. 06%	0. 51%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	-8. 85%	1. 10%	-3. 28%	0. 64%	-5. 57%	0. 46%
过去二年 2010. 10. 01-2012. 09. 30	-14. 85%	1. 17%	-8. 45%	0. 67%	-6. 40%	0. 50%
过去三年 2009. 10. 01-2012. 09. 30	3. 41%	1. 17%	-6. 19%	0. 71%	9. 60%	0. 46%
自成立以来 2009. 03. 24-2012. 09. 30	4. 22%	1. 11%	4. 61%	0. 76%	-0. 39%	0. 35%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》中“投资于股票、债券以及货币市场工具的基金，且不符合股票型和债券型基金的分类标准；且股票投资比例为 30%—80%。如果连续两个季度股票投资比例 $\geq 60\%$ ，则上调风险等级”的说明，兴全有机增长基金的股票投资比例连续两个季度均高于 60%，其中 2012 年二季度、2012 年三季度该基金股票投资比例分别为：60.66%、61.82%，结合上述指标给予该基金的风险等级：高风险。

七、兴全磐稳增利债券型基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金在保证基金资产良好流动性的基础上，通过严格风险控制下的债券及其他证券产品投资，追求低风险下的稳定收益，并争取在基金资产保值的基础上，积极利用各种稳健的投资工具力争资产的持续增值。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括依法公开发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他债券类金融工具。

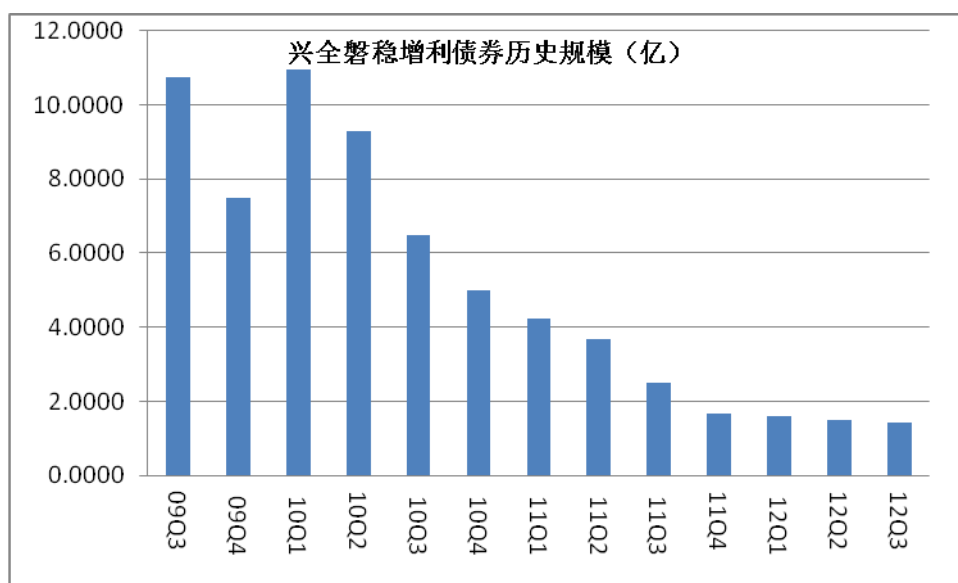
本基金不参与定向增发或网下新股申购,也不在二级市场直接买入股票、权证等权益类资产。本基金可以参与一级市场网上新股申购、公开增发,可以持有可转债转股所得股票及可分离债分离后所得权证,由上述方式获得的股票或权证将在可交易日起 5 个交易日内全部卖出。本基金可以主动投资于纯债收益率为正的可转债,不主动投资于纯债收益率为零或为负的可转债。

本基金各类资产的投资比例为:债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%,其中权证的投资比例为基金资产的 0%-3%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	138,227,558.87	95.94
	其中:债券	138,227,558.87	95.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	1,500,000.00	1.04
	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	1,717,529.20	1.19
6	其他资产	2,626,871.41	1.82
7	合计	144,071,959.48	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全磐稳增利债券	-0.8477	-33.8133	-0.0531	-3.2014	-0.1207	-0.0751	-0.0643	-0.0433

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012. 09. 01-2012. 09. 30	0.02%	0.08%	0.01%	0.06%	0.01%	0.02%
过去三个月 2012. 07. 01-2012. 09. 30	-0.44%	0.06%	0.10%	0.04%	-0.54%	0.02%
过去六个月 2012. 04. 01-2012. 09. 30	2.02%	0.10%	1.99%	0.04%	0.03%	0.06%
今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	3.93%	0.16%	2.85%	0.04%	1.08%	0.12%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	6.25%	0.18%	5.51%	0.05%	0.74%	0.13%

过去二年 2010. 10. 01-2012. 09. 30	-0. 63%	0. 20%	4. 81%	0. 06%	-5. 44%	0. 14%
自成立以来 2009. 07. 22-2012. 09. 30	4. 34%	0. 16%	9. 02%	0. 05%	-4. 68%	0. 11%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：偏低风险。

八、兴全合润分级股票型基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金通过定量与定性相结合精选股票，以追求当期收益与实现长期资本增值。

本基金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。

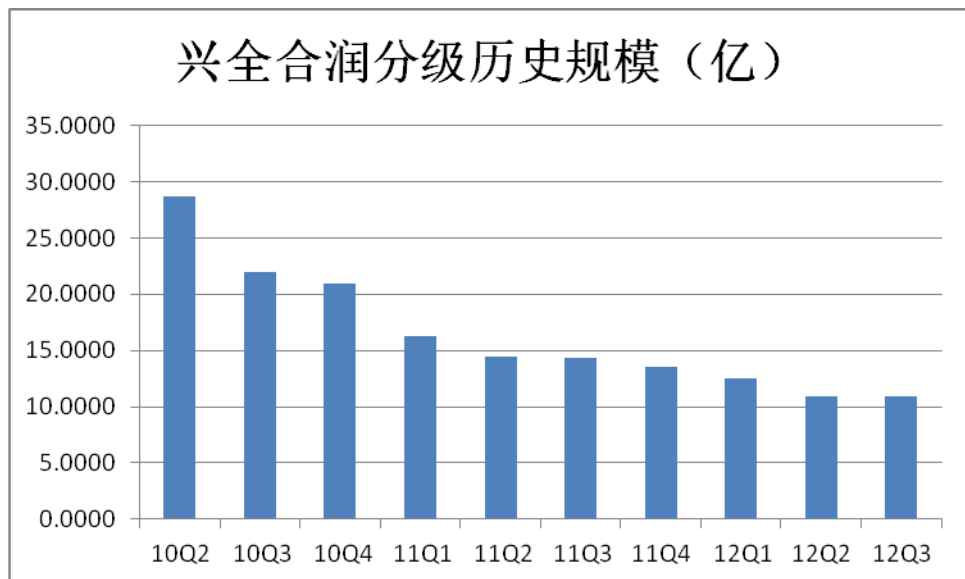
本基金为股票型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	913,326,954.25	77.49
	其中：股票	913,326,954.25	77.49
2	固定收益投资	58,424,600.00	4.96
	其中：债券	58,424,600.00	4.96
	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	196,555,761.25	16.68
6	其他资产	10,297,405.43	0.87
7	合计	1,178,604,720.93	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度		2012 一季度		2012 二季度		2012 三季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全合润分级	-0.8272	-5.752	-1.0547	-7.7816	-1.5801	-0.1264	0.0282	0.0026

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	0.70%	1.56%	3.19%	1.27%	-2.49%	0.29%
过去三个月 2012.07.01-2012.09.30	-6.05%	1.32%	-5.52%	0.95%	-0.53%	0.37%
过去六个月 2012.04.01-2012.09.30	-3.92%	1.22%	-4.84%	0.92%	0.92%	0.30%

今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	-4. 06%	1. 33%	-1. 14%	1. 02%	-2. 92%	0. 31%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	-9. 13%	1. 34%	-7. 54%	1. 04%	-1. 59%	0. 30%
过去二年 2010. 10. 01-2012. 09. 30	-21. 20%	1. 33%	-16. 33%	1. 09%	-4. 87%	0. 24%
自成立以来 2010. 04. 21-2012. 09. 30	-17. 72%	1. 28%	-22. 08%	1. 12%	4. 36%	0. 16%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：高风险。

九、兴全沪深 300 指数型基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

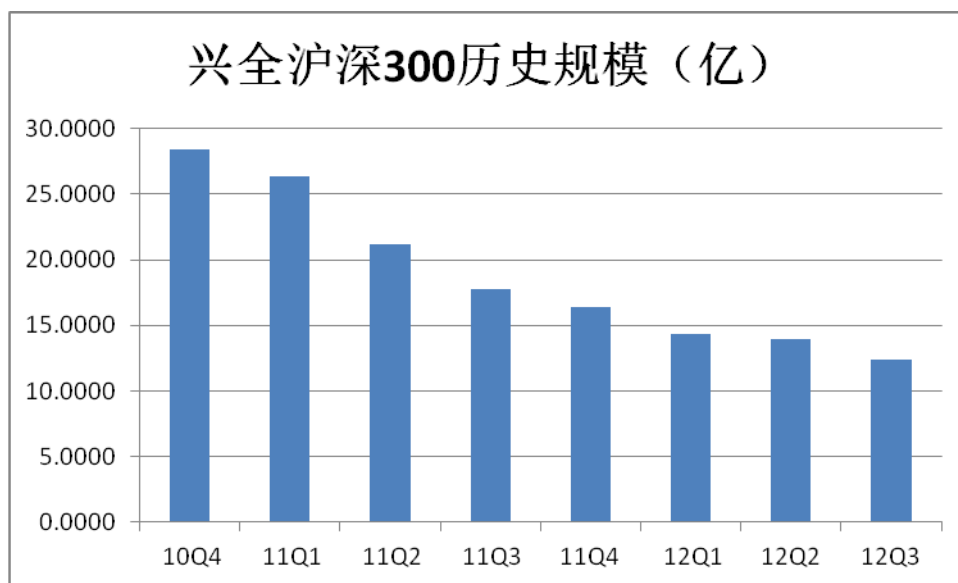
本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1, 169, 874, 832. 96	94. 14

	其中：股票	1,169,874,832.96	94.14
2	固定收益投资	57,975,000.00	4.67
	其中：债券	57,975,000.00	4.67
	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	9,475,810.11	0.76
6	其他资产	5,426,319.09	0.44
7	合计	1,242,751,962.16	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度 规模变化		2012 一季度 规模变化		2012 二季度 规模变化		2012 三季度 规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全沪深300	-1.3602	-7.6746	-2.0246	-12.3734	-0.4271	-0.0298	-1.5320	-0.1101

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012. 09. 01-2012. 09. 30	3. 89%	1. 48%	3. 81%	1. 52%	0. 08%	-0. 04%
过去三个月 2012. 07. 01-2012. 09. 30	-6. 02%	1. 13%	-6. 49%	1. 13%	0. 47%	0. 00%
过去六个月 2012. 04. 01-2012. 09. 30	-5. 68%	1. 07%	-6. 22%	1. 10%	0. 54%	-0. 03%
今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	-1. 41%	1. 18%	-2. 04%	1. 22%	0. 63%	-0. 04%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	-9. 44%	1. 20%	-10. 52%	1. 25%	1. 08%	-0. 05%
自成立以来 2010. 11. 01-2012. 09. 30	-23. 93%	1. 11%	-32. 41%	1. 27%	8. 48%	-0. 16%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标给予该基金的风险等级：高风险。

十、兴全绿色投资股票型基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

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。

本基金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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）。

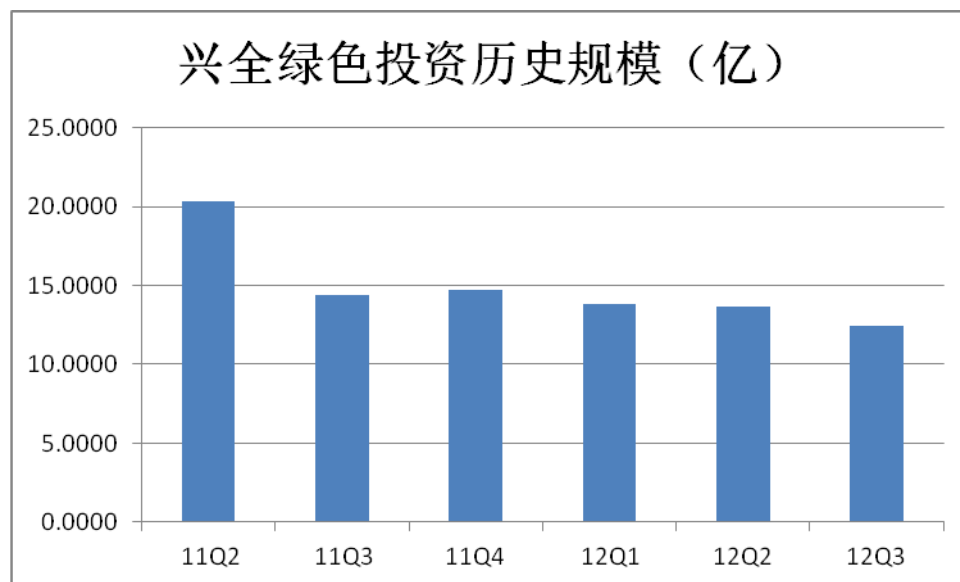
本基金为股票型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合绿色投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不

低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。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。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,057,399,661.96	84.05
	其中：股票	1,057,399,661.96	84.05
2	固定收益投资	98,186,868.80	7.80
	其中：债券	98,186,868.80	7.80
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	50,000,275.00	3.97
	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	26,128,522.95	2.08
6	其他资产	26,294,039.00	2.09
7	合计	1,258,009,367.71	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度 规模变化		2012 一季度 规模变化		2012 二季度 规模变化		2012 三季度 规模变化	
	变化量 （亿）	变化率	变化量 （亿）	变化率	变化量 （亿）	变化率	变化量 （亿）	变化率
兴全绿色投	0.2917	2.0258	-0.8772	-5.9708	-0.1676	-0.0121	-1.1943	-0.0875

资								
---	--	--	--	--	--	--	--	--

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012. 09. 01-2012. 09. 30	0. 46%	1. 34%	3. 19%	1. 27%	-2. 73%	0. 07%
过去三个月 2012. 07. 01-2012. 09. 30	-5. 63%	1. 02%	-5. 52%	0. 95%	-0. 11%	0. 07%
过去六个月 2012. 04. 01-2012. 09. 30	-3. 65%	0. 92%	-4. 84%	0. 92%	1. 19%	0. 00%
今年以来 2012. 01. 01-2012. 09. 30	-3. 33%	0. 99%	-1. 14%	1. 02%	-2. 19%	-0. 03%
过去一年 2011. 10. 01-2012. 09. 30	-5. 94%	0. 96%	-7. 54%	1. 04%	1. 60%	-0. 08%
自成立以来 2011. 05. 05-2012. 09. 30	-12. 90%	0. 89%	-20. 46%	1. 03%	7. 56%	-0. 14%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标暂给予该基金的风险等级：高风险。

十一、兴全保本混合型证券投资基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

本基金投资于优秀公司或有潜力成为优秀公司的股票，力争获取当期收益及实现长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券等）、货币市场工具、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其

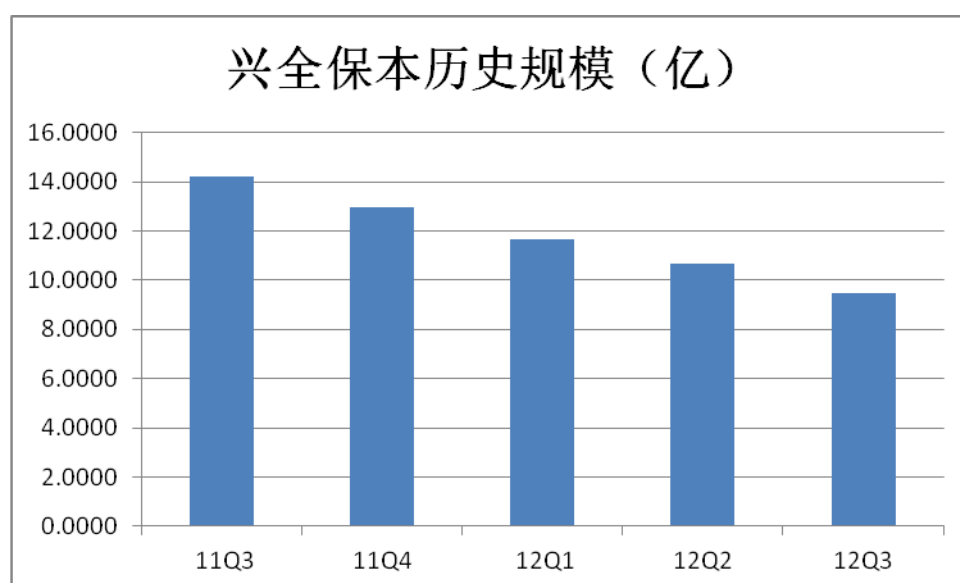
他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 0%-30%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 70%-100%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	45,841,631.14	4.59
	其中：股票	45,841,631.14	4.59
2	固定收益投资	864,190,315.75	86.45
	其中：债券	864,190,315.75	86.45
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,165.00	3.00
	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	38,325,535.88	3.83
6	其他资产	21,227,189.79	2.12
7	合计	999,584,837.56	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2011 四季度 规模变化		2012 一季度 规模变化		2012 二季度 规模变化		2012 三季度 规模变化	
	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率	变化量 (亿)	变化率
兴全保本	-1.2218	-8.6086	-1.2935	-9.9723	-1.0084	-0.0864	-1.2140	-0.1138

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012.09.01-2012.09.30	-0.34%	0.20%	0.35%	0.01%	-0.69%	0.19%
过去三个月 2012.07.01-2012.09.30	-1.83%	0.19%	1.10%	0.01%	-2.93%	0.18%
过去六个月 2012.04.01-2012.09.30	0.04%	0.21%	2.36%	0.01%	-2.32%	0.20%
今年以来 2012.01.01-2012.09.30	1.60%	0.25%	3.66%	0.01%	-2.06%	0.24%
自成立以来 2011.08.02-2012.09.30	0.13%	0.30%	5.86%	0.02%	-5.73%	0.28%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标暂给予该基金的风险等级：偏低风险。

十二、兴全轻资产投资股票型证券投资基金

1、基金投资方向、投资范围和投资比例：

以挖掘“轻资产公司”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

本基金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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证

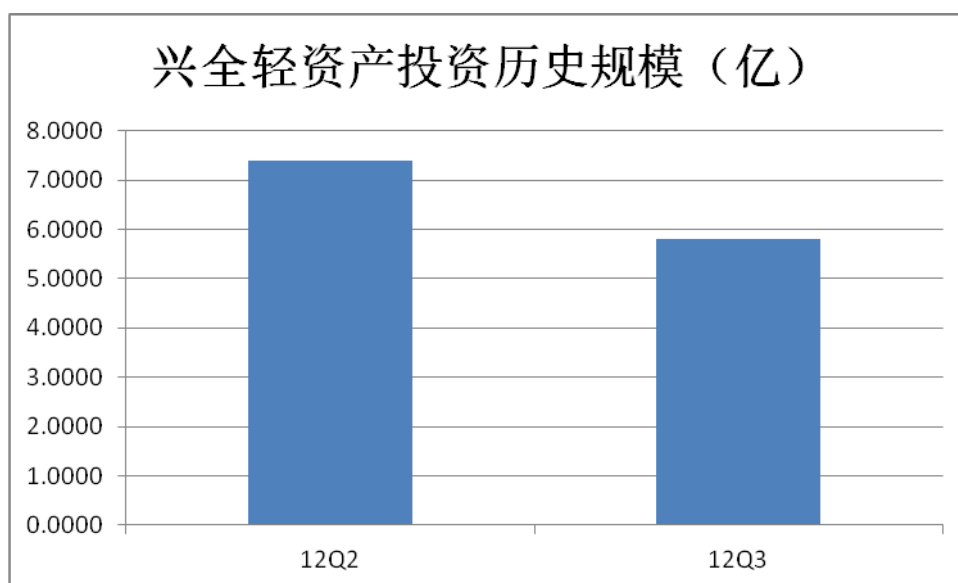
券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金为股票型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合轻资产投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

2、2012 年三季度各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	369,443,923.30	63.42
	其中：股票	369,443,923.30	63.42
2	固定收益投资	38,680,000.00	6.64
	其中：债券	38,680,000.00	6.64
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	78,200,557.30	13.42
	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	47,948,918.65	8.23
6	其他资产	48,298,854.28	8.29
7	合计	582,572,253.53	100.00

3、本基金历史规模



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2012 三季度 规模变化	
	变化量（亿）	变化率
兴全轻资产	-1.5996	-0.2164

4、本基金过往业绩与波动程度

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
过去一个月 2012. 09. 01-2012. 09. 30	1.17%	1.11%	3.19%	1.27%	-2.02%	-0.16%
过去三个月 2012. 07. 01-2012. 09. 30	-4.33%	0.90%	-5.52%	0.95%	1.19%	-0.05%
自成立以来 2012. 04. 05-2012. 09. 30	-5.00%	0.68%	-4.84%	0.92%	-0.16%	-0.24%

截止日期：2012 年 9 月 30 日

5、基金成立以来有无违规行为

无。本季度该基金及基金管理人均无任何违规行为。

依据《公司旗下基金产品风险评价方法说明》，结合上述指标暂给予该基金的风险等级：高风险。

旗下基金风险评价 2012 年第三季度结果汇总

被评估时间段	基金名称	风险等级
2012 年三季度	兴全趋势投资基金	高风险
2012 年三季度	兴全可转债基金	中等风险
2012 年三季度	兴全全球视野基金	高风险
2012 年三季度	兴全社会责任基金	高风险
2012 年三季度	兴全有机增长基金	高风险
2012 年三季度	兴全磐稳债券基金	偏低风险
2012 年三季度	兴全货币市场基金	低风险
2012 年三季度	兴全合润分级基金	高风险
2012 年三季度	兴全沪深 300 基金	高风险
2012 年三季度	兴全绿色投资基金	高风险
2012 年三季度	兴全保本基金	偏低风险
2012 年三季度	兴全轻资产基金	高风险