兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人：兴全基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：2019年7月19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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年7月18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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全沪深300指数（LOF）
场内简称	兴全300
基金主代码	163407
交易代码	163407
基金运作方式	A类：上市契约型开放式（LOF）、C类：契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月2日
报告期末基金份额总额	1,751,397,359.15份
投资目标	本基金采用指数复制结合积对增强的投资策略，即通过指数复制的方法贴合、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积对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金为中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%。
投资策略	本基金采用指数复制结合积对增强的投资策略，即通过指数复制的方法贴合、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积对增强的组合管理。
业绩比较基准	沪深300指数×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求能近或超越沪深300指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	兴全沪深300指数(LOF)A　　兴全沪深300指数C
下属分级基金的场内简称	兴全300　　–
下属分级基金的交易代码	163407　　007230
下属分级基金的前端交易代码	–　　–
下属分级基金的后端交易代码	–　　–
报告期末下属分级基金的份额总额	1,696,243,125.13份　　55,154,234.02份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求能近或超越沪深300指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。投资者可在二级市场买卖A类基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖A类基金份额有可能面临相应的价差风险。　　本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求能近或超越沪深300指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

注：自2019年6月5日起增设兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）C类份额，以A类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

§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（2019年4月1日 - 2019年6月30日）	
	兴全沪深300指数(LOF)A	兴全沪深300指数C
1.本期已实现收益	49,647,703.94	706,286.01
2.本期利润	82,122,077.74	3,414,614.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0518	0.1405
4.期末基金资产净值	3,304,608,334.12	107,428,986.06
5.期末基金份额净值	1.9482	1.9478

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.经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自2019年6月5日起增设兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）C类份额（代码：007230），详情请见管理人网站公告。

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

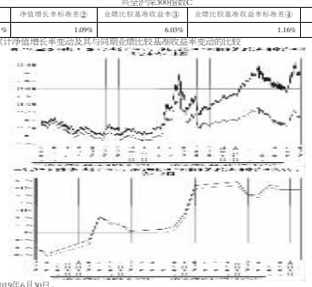
兴全沪深300指数（LOF）A

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	2.57%	1.43%	-1.10%	1.45%	3.67%	-0.02%

兴全沪深300指数C

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	6.31%	1.09%	6.03%	1.16%	0.28%	-0.07%

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



注：1.净值表现所取数据截至到2019年6月30日。

2.按照《兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为2010年11月2日至2011年5月1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.经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自2019年6月5日起增设兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）C类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

3.3 其他指标

无。

§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		
申庆	本基金、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理	2010年11月2日	-	22年	工商管理硕士，历任兴全基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、基金管理部总监助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。

注：1.职务指最上期告期末的职务（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（基金成立时期则任基金经理）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遵规守信情况的说明

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、《兴全沪深300指数增强型证券投资基金（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、致力于市场、致力于投资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。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源，考察是否存在非公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

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 报告期内基金投资策略和业绩分析

二季度国有中美贸易摩擦影响造成市场波动，核心资产表现突出，行业龙头相对和绝对收益均很显著，反映出A股市场表现重回价值正轨。相反，一季度“业绩爆雷”指数表现拉锯的担忧状态被抹去，很多无基头分析的概念股，爆雷股，债券，呈现从哪里来回那里去，并还在不断创出新低的趋势。

监管部门的各项举措和二季度的市场表现与我们一季报及长期坚持的预判是吻合的，这不仅进一步坚定了我们的信心，也在不断改善市场的预期和投资理念。许多以及还将继续发生的这几年股的表演，不断告诫与警示投资者，A股市场回不到过去鸡犬升天、胡乱炒作的时代了。

本基金的权益组合始终坚持择取产品属性、在行业及风格合理分散的前提下，坚定持有那些估值安全、流动性好的行业及龙头公司。在此基础上深入挖掘其他有特色，当前财务稳健、估值被严重低估，未来发展有潜力的公司。除此之外，不断挖掘各种无风险、低风险下的绝对收益和超额收益的投资机会也是本基金管理人始终坚持的工作重点。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全沪深300指数（LOF）A基金份额净值为1.9482元，本报告期基金份额净值增长率为2.57%，同期业绩比较基准收益率为-1.10%；截至本报告期末兴全沪深300指数C基金份额净值为1.9478元，本报告期基金份额净值增长率为6.31%，同期业绩比较基准收益率为6.03%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	3,198,149,710.57	90.52
	其中：股票	3,198,149,710.57	90.52
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	311,046,076.80	8.80
	其中：债券	311,046,076.80	8.80
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	8,567,568.93	0.24
8	其他资产	15,242,505.03	0.43
9	合计	3,533,005,861.33	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	105,818,410.16	3.10
C	制造业	985,097,926.80	28.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,116,602.34	2.00
E	建筑业	81,866,171.02	2.40
F	批发和零售业	36,833,195.90	1.08
G	交通运输、仓储和邮政业	98,585,027.97	2.89
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	105,171,667.24	3.08
J	金融业	1,337,375,886.39	39.20
K	房地产业	126,836,468.38	3.71
L	租赁和商务服务业	86,509,504.79	2.54
M	科学研究和技术服务业	410,949.88	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	14,324,252.00	0.42
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	22,994,478.00	0.67
S	综合	–	–
	合计	3,069,762,640.87	89.97

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	1,042,566.00	0.03
B	采矿业	16,914,851.95	0.50
C	制造业	70,870,370.41	2.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,386.82	0.00
E	建筑业	1,216,023.45	0.04
F	批发和零售业	3,314,338.87	0.10
G	交通运输、仓储和邮政业	2,890,955.89	0.08
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,115,513.71	0.09
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	4,512,798.59	0.13
L	租赁和商务服务业	274,794.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	213,847.32	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	23,043,509.33	0.68
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	921,243.42	0.03
S	综合	–	–
	合计	128,387,069.70	3.76

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

5.3.1 报告期末按投资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	601318	中国平安	3,198,412	283,411,287.32	8.31
2	601601	中国太保	5,638,158	205,849,148.58	6.03
3	600519	贵州茅台	112,800	110,995,200.00	3.25
4	600036	招商银行	3,018,838	108,617,791.24	3.18
5	601336	新华保险	1,764,659	97,109,184.77	2.85
6	601888	中国国旅	915,200	81,132,480.00	2.38
7	600741	华域汽车	3,680,984	79,509,254.40	2.33
8	601009	南京银行	9,423,600	77,838,936.00	2.28
9	600690	海尔智家	4,398,838	76,055,909.02	2.23
10	601166	兴业银行	4,118,800	75,332,852.00	2.21

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600195	中牧股份	2,158,895	29,900,695.75	0.88
2	601200	上海环境	1,646,598	21,105,198.78	0.62
3	002821	凯莱英	121,418	11,908,677.44	0.35
4	000983	西山煤电	1,193,101	7,230,192.06	0.21
5	601699	潞安环能	756,100	6,003,434.00	0.18

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	10,678,450.40	0.31
2	央行票据	–	–
3	金融债券	171,964,413.00	5.04
	其中：政策性金融债	171,964,413.00	5.04
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	128,403,213.40	3.76
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	311,046,076.80	9.12

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	160215	16国开15	700,000	70,028,000.00	2.05
2	132018	G三峡EB1	333,880	33,388,000.00	0.98
3	108901	农发1801	325,650	32,597,565.00	0.96
4	108602	国开1704	180,800	18,262,608.00	0.54
5	110051	中天转债	155,300	16,325,136.00	0.48

5.6 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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	354,902.58
2	应收证券清算款	1,090,385.91
3	应收股利	–
4	应收利息	3,026,684.95
5	应收申购款	10,770,531.59
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	15,242,505.03

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132015	18中油EB	12,449,650.20	0.36
2	110046	圣莱转债	11,790,572.40	0.35
3	132014	18中化EB	11,276,712.00	0.33
4	113020	桐昆转债	4,990,440.00	0.15
5	110049	海尔转债	2,685,542.40	0.08
6	110041	蒙发转债	2,235,000.00	0.07
7	132013	17冶化EB	2,087,746.60	0.06
8	113525	台华转债	2,070,943.20	0.06
9	113011	光大转债	1,132,780.00	0.03
10	128047	光电转债	971,208.00	0.03
11	127005	长证转债	719,076.00	0.02
12	128024	宁行转债	559,969.80	0.02
13	127006	敖东转债	250,102.60	0.01
14	132012	17江化EB	172,608.00	0.01
15	110042	航电转债	93,324.20	0.00
16	123009	星源转债	5,297.24	0.00
17	110043	无锡转债	3,027.30	0.00
18	125003	盛思转债	2,903.10	0.00
19	128036	金宏转债	1,355.70	0.00
20	110038	井神转债	1,058.60	0.00
21	113505	杭电转债	1,047.50	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601200	上海环境	19,110,000.00	0.56	大宗交易购入流通受限

5.11.6 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

项目	兴全沪深300指数(LOF)A	兴全沪深300指数C
报告期期初基金份额总额	1,487,981,936.19	–
报告期期间基金总申购份额	623,282,896.74	55,254,833.24
减:报告期期间基金总赎回份额	415,021,707.80	100,599.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
报告期期末基金份额总额	1,696,243,125.13	55,154,234.02

5.11.6 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

项目	兴全沪深300指数(LOF)A	兴全沪深300指数C
报告期期初基金份额总额	1,487,981,936.19	–
报告期期间基金总申购份额	623,282,896.74	55,254,833.24
减:报告期期间基金总赎回份额	415,021,707.80	100,599.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
报告期期末基金份额总额	1,696,243,125.13	55,154,234.02

注：1.此处的任职日期和离任日期均指基金合同生效日或公司作出决定之日。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责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，无违规基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《公平交易制度》和《公平交易执行制度》等，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理、投资经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对股票交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；另外，本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，本基金管理人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超过该证券当日成交量的5%的情况有1次，原因是指数型投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

MSCI中国A股指数其成分股均在沪股通和深股通的范围之内，方便境外投资者交易；指数包含已纳入和未来将要纳入MSCI的成分股，可以充分分享“入摩”红利。

在建仓期内，我们结合指数特点，研判市场行情，低位建仓，准确把握住了阶段性行情。同时我们运用自行开发的量化投资管理系统，采用系统管理和人工管理相结合的方式模拟处理基金日常运作中所碰到的申购赎回处理、结构配比校验、风险优化等一系列事件，通过预先进行压力测试，争取上市后将本基金的跟踪误差控制在合理水平，并取得一定的相对收益。

展望2019年第三季度，我们对市场持谨慎乐观态度。随着G20峰会后中美双方重启谈判，带来贸易摩擦的边际缓和，市场风险偏好得到修复；随着富时罗素纳入A股和MSCI纳入A股继续扩容，外资的进入会为资本市场带来新活力，有利于进一步推动内地股票市场的对外开放，为A股市场引入长期资金。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.9633；本报告期基金份额净值增长率为-2.96%，同期业绩比较基准收益率为-4.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	1,843,566,983.68	98.31
	其中：股票	1,843,566,983.68	98.31
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	21,509,218.61	1.15
8	其他资产	10,147,671.37	0.54
9	合计	1,875,223,873.66	100.00

注：股票投资含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	25,117,248.76	1.35
B	采矿业	65,311,289.42	3.51
C	制造业	807,875,009.83	43.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,051,423.50	2.53
E	建筑业	45,873,191.10	2.46
F	批发和零售业	37,715,942.94	2.03
G	交通运输、仓储和邮政业	54,880,444.91	2.95
H	住宿和餐饮业	2,334,900.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,861,215.71	4.61
J	金融业	525,178,102.56	28.21
K	房地产业	89,471,634.69	4.81
L	租赁和商务服务业	24,312,397.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	1,755,006.72	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	3,080,411.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	12,992,454.10	0.70
R	文化、体育和娱乐业	11,945,628.44	0.64
S	综合	2,811,390.00	0.15
	合计	1,843,567,690.68	99.02

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

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	600519	贵州茅台	94,697	93,181,848.00	5.00
2	601318	中国平安	808,469	71,638,438.09	3.85
3	600036	招商银行	1,535,075	55,231,998.50	2.97
4	000858	五粮液	289,005	34,088,139.75	1.83
5	601166	兴业银行	1,550,263	28,354,310.27	1.52
6	600000	浦发银行	2,186,847	25,542,372.96	1.37
7	601398	工商银行	4,021,700	23,687,813.00	1.27
8	600276	恒瑞医药	330,310	21,800,460.00	1.17
9	000002	万科A	727,106	20,220,817.86	1.09
10	601288	农业银行	5,547,200	19,969,920.00	1.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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资产支持证券投资明细

注：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序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期不存在被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	370,509.34
2	应收证券清算款	9,771,986.96
3	应收股利	–
4	应收利息	5,175.07
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	10,147,671.37

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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，比例的分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全沪深300指数(LOF)A	兴全沪深300指数C
报告期期初基金份额总额	1,487,981,936.19	–
报告期期间基金总申购份额	623,282,896.74	55,254,833.24
减:报告期期间基金总赎回份额	415,021,707.80	100,599.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
报告期期末基金份额总额	1,696,243,125.13	55,154,234.02

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

注：本基金的基金管理人于本报告期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

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/05/17-2019/06/30	29,999,833.33	0.00	0.00	29,999,833.33	37.50%
	2	2019/04/25-2019/06/24	50,000,388.88	0.00	50,000,388.88	0.00	0.00%
产品特有风险							

投资人在投资本基金时，将面临本基金的特有风险，具体包括：

1）当基金份额申购赎回时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在日开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

2）在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回日本基金资产规模比赎低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；

3）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，要投资触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；

4）当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益不平发生波动，同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入，管理费及托管费费用是按照一日费产费，会导致基金份额净值出现大幅波动；

5）当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请，在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险，如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2019年4月18日发布《银华安享短债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》，自2019年4月22日起开放本基金的日常申购、赎回、定期定额投资、转换转入及转换转出业务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 银华安享短债债券型证券投资基金基金募集申请获中国证监会注册的文件

9.1.2《银华安享短债债券型证券投资基金基金合同》

9.1.3《银华安享短债债券型证券投资基金招募说明书》

9.1.4《银华安享短债债券型证券投资基金托管协议》

9.1.5《银华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

9.1.6 本基金管理人业务资格批件和营业执照

9.1.7 本基金托管人业务资格批件和营业执照

9.1.8 本报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

9.2 存放地点

上述备查文本存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。本报告存放在本基金管理人及托管人住所，供公众查阅、复制。

9.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.yhfund.com.cn）查阅。

银华基金管理股份有限公司
2019年7月19日

银华安享短债债券型证券投资