基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24日

兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

§1 重要提示

1.1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。本半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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	兴全轻资产混合(LOF)
场内简称	兴全轻资
基金主代码	163412
前端交易代码	163412
后端交易代码	163413
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年4月5日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,562,756,076.25份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年5月31日

2.2基金产品说明

投资目标	本基金以挖掘“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。
投资策略	在大类资产配置上,本基金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;本基金运用多重指标因子,综合评估判断,选择优秀的轻资产公司进行投资;在行业配置上,除积极配置于那些在产品、服务以及业务属性上具有轻资产特征的行业。
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	本基金为混合型基金产品,属于较高风险、较高收益的基金品种,其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。投资者可在二级市场买卖基金份额,受市场供需关系等各种因素的影响,投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

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		兴全基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099,021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	217,583,422.05
本期利润	1,140,083,906.65
加权平均基金份额本期利润	0.6679
本期基金份额净值增长率	22.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	1.7284
期末基金资产净值	5,280,413,720.93
期末基金份额净值	3.379

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。

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),计入费用后实购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
过去一个月	6.83%	1.19%	4.42%	0.92%	2.41%	0.27%
过去三个月	0.24%	1.55%	-0.87%	1.22%	1.11%	0.33%
过去六个月	22.34%	1.49%	21.75%	1.24%	0.59%	0.25%
过去一年	12.86%	1.45%	8.73%	1.22%	4.13%	0.23%
过去三年	30.51%	1.14%	19.57%	0.89%	10.94%	0.25%
自基金合同生效起至今	373.31%	1.64%	55.66%	1.19%	317.65%	0.45%

注:本基金业绩比较基准为:80%×沪深300指数+20%×中证国债指数,在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:沪深300指数和中证国债指数具有较强的代表性。沪深300指数选择中国A股市场市值规模最大、流动性强和基本因素良好的300家上市公司作为样本股,充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证国债指数反映了交易所国债整体走势,是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

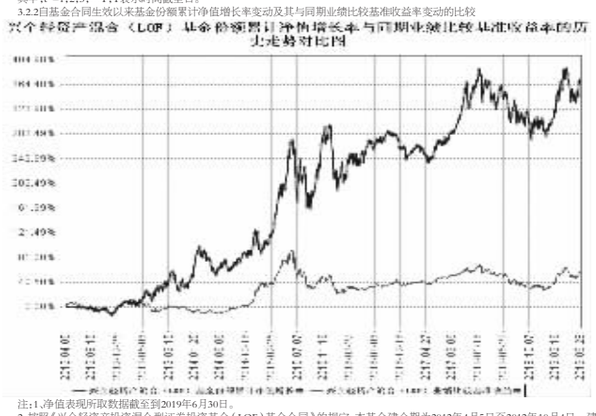
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =80%×(沪深300指数t / 沪深300指数t-1 -1)+20%×(中证国债指数t / 中证国债指数t-1 -1)

Benchmark t =(1+Return t)×(1+Benchmark t-1)-1

其中,t =1,2,3,…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



注:1、净值表现所取数据截至到2019年6月30日。

2、按照《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2012年4月5日至2012年10月4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

兴全基金管理有限公司(成立时名为“兴业基金管理有限公司”,以下简称“公司”)经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立,2008年1月,中国证监会批复(证监许可[2008]6号),同意全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日,公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后,公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元,其中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%。2008年7月,经中国证监会批准(证监许可[2008]588号),公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后,公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”,注册资本增加为1.5亿元人民币,其中两股东出资比例不变。2016年12月28日,因公司发展需要,公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。

截止2019年6月30日,公司旗下管理着26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、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全整稳增利债券型证券投资基金、兴全润分股混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(LOF)、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
董理	本基金、兴全多维价值混合型证券投资基金基金经理	2017年11月23日	-	11年	数学博士,历任国信智能有限公司技术部系统工程师,嘉实基金管理有限公司分析师、基金经理,华夏久盈资产管理有限公司投资经理,兴全基金管理有限公司兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。

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(基金成立时间旧任基金经理)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、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(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、业绩评估等环节监控关,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

上半年市场经历了较大幅度的震荡,一季度风险偏好提升带来的收益,随着宏观经济的逐季回落,以及贸易战风险的再次加剧,二季度出现了较大幅度的回调。我们认为,今年经济的逐渐寻底已经在市场价格中得到了充分体现,外部环境的变化并未根本性改变经济的趋势,因此在这个扰动过程中,我们并不适合主动采用仓位的方式回避风险,组合维持了较高的仓位水平。结构上,我们一季度末逐步兑现了2018年底买入的超跌的部分小盘成长股,降低了受贸易战影响较大的细分行业的持仓比例,提高了依靠内需的消费类股票的配置比例。基于对科技类产业远期良好的成长前景,我们依然保留了部分竞争力优势明显、行业趋势逐渐向好的股票持仓。

4.4.2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3.379元;本报告期基金份额净值增长率为22.34%,业绩比较基准收益率为21.75%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,随着政策力度的不断加强和外部环境逐渐趋于平稳,尤其是货币环境的改善,使得我们经济底部越来越接近,对于明年我们抱有相当乐观的态度。今年下半年将会是分化加剧的时期,早周期行业将迎来拐点,而晚周期行业却将面临业绩的巨大压力。所以不能简单用周期和消费的结构区分下半年行情,而要具体分析不同行业所处的阶段。传统美林时钟的行业周期阶段划分也无法参考,因为不同行业处于不同的库存周期阶段、不同的竞争格局、不同的需求周期阶段。历史不会简单的重发,但发生后我们又总会觉得惊人的相似。我们要做的是分析出那些会重复的部分,提前布局,追求高风险收益比的确定性回报。总体上,对于股票市场,下半年机遇风险并存,但是过度悲观一定是最大的风险。

4.6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。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	98,494,147.96	168,440,587.02
结算备付金		2,731,581.59	5,261,217.40
存出保证金		1,741,638.59	1,614,586.09
交易性金融资产	6.4.7.2	5,175,582,608.40	4,855,390,781.49
其中:股票投资		4,903,494,155.10	4,592,221,303.79
基金投资		-	-
债券投资		272,088,453.30	263,169,477.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		23,807,698.50	17,741,265.34
应收利息	6.4.7.5	5,097,946.11	7,680,121.51
应收股利		-	-
应收申购款		4,708,226.36	19,349,819.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,312,163,847.51	5,075,478,378.69

负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		21,738,840.06	3,843,552.75
应付管理人报酬		6,267,544.31	6,553,387.58
应付托管费		1,044,590.69	1,092,231.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,526,861.42	2,130,907.26
应交税费		2.75	99.68
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	172,287.35	368,819.52
负债合计		31,750,126.58	13,988,998.05
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,562,756,076.25	1,832,225,489.21
未分配利润	6.4.7.10	3,717,657,644.68	3,229,263,891.43
所有者权益合计		5,280,413,720.93	5,061,489,380.64
负债和所有者权益总计		5,312,163,847.51	5,075,478,378.69

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值3.379 元,基金份额总额1,562,756,076.25份。

6.2利润表

会计主体:兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入		1,198,763,020.43	-447,396,149.50
1.利息收入		5,833,450.36	7,178,394.54
其中:存款利息收入	6.4.7.11	992,256.38	1,965,479.87
债券利息收入		4,841,193.98	5,180,165.08
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	32,749.59
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		266,725,024.06	637,109,338.92
其中:股票投资收益	6.4.7.12	210,630,324.03	607,255,123.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,725,009.88	2,733,042.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	53,349,690.15	27,121,172.65
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	922,500,484.60	-1,096,383,460.88
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	3,704,061.41	4,699,577.92
减:二、费用		58,679,113.78	68,110,425.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	39,976,980.37	42,174,171.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,662,830.02	7,029,028.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	11,871,230.06	18,686,590.36
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		28.33	56.28
7. 其他费用	6.4.7.20	168,045.00	220,578.70
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,140,083,906.65	-515,506,575.26
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,140,083,906.65	-515,506,575.26

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30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)	1,832,225,489.21	3,229,263,891.43	5,061,489,380.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,140,083,906.65	1,140,083,906.65
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)	-269,469,412.96	-651,690,153.40	-921,159,566.36
其中:1.基金申购款	314,794,845.36	673,702,388.83	988,497,234.19
2.基金赎回款	-584,264,258.32	-1,325,392,542.23	-1,909,656,800.55
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)	1,562,756,076.25	3,717,657,644.68	5,280,413,720.93

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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)	1,561,978,868.35	3,531,260,967.16	5,093,239,835.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-515,506,575.26	-515,506,575.26
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)	202,518,126.32	502,759,424.13	705,277,550.45
其中:1.基金申购款	834,220,163.98	1,923,923,507.31	2,758,143,671.29
2.基金赎回款	-631,702,037.66	-1,421,164,083.18	-2,052,866,120.84
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)	1,764,496,994.67	3,518,513,816.03	5,283,010,810.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

兰荣 庄园芳 巅鸿飞

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4报表附注

6.4.1基金基本情况

兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)(原名兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF),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[2011]2161号文《关于核准兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准,由兴全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2012年4月5日正式生效,首次设立募集规模为993,929,233.72份基金份额。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于2015年8月7日起更名为兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)。

本基金投资范围是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)。

本基金为混合型基金,股票投资比例为基金资产的60%-95%,其中,符合轻资产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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数+20%×中证国债指数。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3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2019年6月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4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。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3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。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)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,暂不缴纳企业所得税。

(3)对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

(5)对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴全基金管理有限公司(以下简称“兴全基金”)	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	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

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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	1,017,955,671.71	11.24%	943,987,998.07	6.51%

6.4.8.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	407,026.03	1.63%	-	-

6.4.8.1.3债券回购交易

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回购交易。

6.4.8.1.4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。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30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	948,869.28	15.48%	223,446.31	8.84%

关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	879,141.66	8.59%	879,141.66	17.77%

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),管理人因此认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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	39,976,980.37	42,174,171.77
其中:支付销售机构的客户维护费	13,330,012.98	13,548,639.93

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,662,830.02	7,029,028.65

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。

6.4.8.2.3销售服务费

无。

6.4.8.3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。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
期初持有的基金份额	-	4,772,792.36
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	4,772,792.36
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.2705%

6.4.8.4.2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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴全睿众	4,792,536.80	0.3067%	4,792,536.80	0.2616%

6.4.8.5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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	98,494,147.96	911,398.61	834,376,542.36	1,837,288.97

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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

6.4.12.1.1 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
002120	韵达股份	2018年4月20日	2020年4月23日	非公开发行流通受限	39.75	28.60	1,081,571	42,992,447.25	30,932,930.60	-
002120	韵达股份	2018年8月16日	2020年4月23日	非公开发行流通受限-转增	-	28.60	324,471	-	9,279,870.60	注1
002120	韵达股份	2019年6月12日	2020年4月23日	非公开发行流通受限-转增	-	28.60	421,813	-	12,063,851.80	注2
002384	东山精密	2019年3月18日	2019年9月18日	大宗交易购入流通受限	15.20	13.61	3,800,000	57,760,000.00	51,718,000.00	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

注:1.本基金持有的非公开发行股票韵达股份,于2018年8月16日实施2017年年度权益分配方案,向全体股东每10股派发现金股利人民币2.38元(含税),同时,以资本公积金向全体股东每10股转增3股。本基金新增324,471股。

2.本基金持有的非公开发行股票韵达股份,于2019年6月12日实施2018年年度权益分配方案,向全体股东每10股派发现金