兴全趋势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

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

基金托管人兴业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	兴全趋势投资混合（LOF）
场内简称	兴全趋势
基金主代码	163402
前端交易代码	163402
后端交易代码	163403
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005年11月3日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
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	24,251,733,537.04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	2006年1月19日

2.2基金产品说明

投资目标	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；分享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。
投资策略	根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置；运用兴全多维趋势分析系统，对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析，并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面，本基金主要运用“兴全固定收益证券组合优化模型”，在固定收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。
业绩比较基准	沪深300指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险，中高风险，中高回报的基金产品。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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	龚小武
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212056
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	gongxiaowu@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	492,341,546.21
本期利润	3,621,033,018.82
加权平均基金份额本期利润	0.1590
本期基金份额净值增长率	27.68%
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	0.1241
期末基金资产净值	18,291,596,572.93
期末基金份额净值	0.7542

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
过去一个月	2.75%	1.12%	2.93%	0.57%	-0.18%	0.55%
过去三个月	-0.48%	1.36%	-0.46%	0.74%	-0.02%	0.62%
过去六个月	27.68%	1.39%	13.87%	0.76%	13.81%	0.63%
过去一年	13.80%	1.35%	7.65%	0.75%	6.15%	0.60%
过去三年	36.29%	1.01%	15.84%	0.55%	20.45%	0.46%
自基金合同生效起至今	1,441.57%	1.22%	199.23%	0.87%	1,242.34%	0.35%

注：本基金业绩比较基准为沪深300指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本基金采用沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债市场（包括银行间、上交所、深交所）的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。基于本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

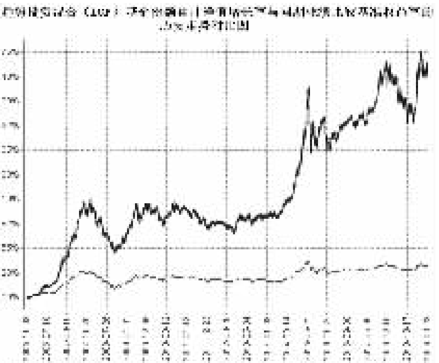
本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

Return t =50%×(沪深300指数t / 中证国债指数t-1 -1) +45%×(沪深300指数t / 中证国债指数t-1 -1) + 5%×(同业存款利率t / 360)

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《兴全趋势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2005年11月3日至2006年5月2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]888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、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级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		
董承非	副总经理兼研究部总监、本基金、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、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理	2013年10月28日	–	15年	理学硕士，历任兴全基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理、基金管理部副总监、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理，上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事，兴全基金管理有限公司基金管理部投资总监。
乔迁	本基金、兴全有机灵活配置混合型证券投资基金基金经理、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2017年7月13日	–	11年	工商管理硕士，历任兴全基金管理有限公司行业研究员、兴全合润分级混合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、《兴全趋势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

2019年上半年A股市场表现不错，主要得益于年初的宏观经济好于大家的悲观预期，以及政府为了对冲贸易战所做的对内的一些对冲措施。但是市场在4月份对内政策调整和对外贸易谈判停滞的影响下步入调整阶段。本基金今年基本上抓住了市场上涨的节奏，虽然在板块的配置上没有配置到表现最好的行业。

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0.7542元；本报告期基金份额净值增长率为27.68%，业绩比较基准收益率为13.87%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

观察中国政府的对内政策，虽然会根据外部形势及时做一些微调和对冲，但是去杠杆应该是一个长期一致的工作重点，这个从四月份政策转向和后续一系列破除刚兑的事件就可以看出。这也意味着对未来宏观经济不能做太高的预期。今年A股市场经历过一波的估值修复后，整个市场的估值水平虽然不是很贵，但是低估是谈不上了。所以我们也要降低市场下半年的投资回报预期。

由于对外的不确定性，国内投资者纷纷将持仓集中在内需为主的核心资产上面，特别是以白酒为代表的高端消费。中短期不好说，但是如果没有制造业和科技行业的崛起，这些板块能否保持目前的这样的景气度是值得怀疑的。

本基金还是会坚持原来的投资风格，为持有人争取好的回报。

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》、《兴全趋势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，本报告期内未进行利润分配，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

本托管人依据《兴全趋势投资混合型证券投资基金（ LOF ）基金合同》与《兴全趋势投资混合型证券投资基金（ LOF ）托管协议》，自2005年11月3日起托管兴全趋势投资混合型证券投资基金（ LOF ）（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

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1资产负债表

会计主体：兴全趋势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	3,684,743,191.02	1,443,122,942.82
结算备付金		7,604,245.22	2,713,266.62
存出保证金		1,876,249.78	2,210,834.67
交易性金融资产	6.4.7.2	14,601,127,615.32	11,388,113,045.54
其中：股票投资		14,485,037,780.10	10,967,383,191.76
基金投资		–	–
债券投资		116,089,835.22	420,729,853.78
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		6,577,988.69	185,359,208.97
应收利息	6.4.7.5	1,999,979.94	6,736,943.72
应收股利		–	–
应收申购款		73,284,673.20	31,446,254.49
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	–	–
资产总计		18,377,213,943.17	13,059,702,496.83
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		22,281,817.58	–
应付赎回款		34,361,811.81	53,028,558.86
应付管理人报酬		21,769,003.23	17,093,710.15
应付托管费		3,628,167.20	2,848,951.72
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	6.4.7.7	3,333,535.49	2,423,219.30
应交税费		3,042.95	3,449.29
应付利息		–	–
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	6.4.7.8	239,991.98	565,057.03
负债合计		85,617,370.24	75,962,946.35
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,072,180,006.23	5,503,273,808.13
未分配利润	6.4.7.10	12,219,416,566.70	7,480,465,742.35
所有者权益合计		18,291,596,572.93	12,983,739,550.48
负债和所有者权益总计		18,377,213,943.17	13,059,702,496.83

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值0.7542元，基金份额总额24,251,733,537.04份。

6.2利润表

会计主体：兴全趋势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		3,772,178,947.83	-909,173,289.78
1.利息收入		22,437,022.92	25,085,896.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,682,247.28	8,219,709.32
债券利息收入		3,222,210.21	15,477,320.72
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		532,565.43	1,388,866.67
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		617,206,720.27	1,077,595,148.89
其中：股票投资收益	6.4.7.12	495,144,495.28	974,002,801.25
基金投资收益		–	–
债券投资收益	6.4.7.13	1,590,361.56	-1,308,260.73
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	120,471,863.43	104,900,608.37
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,128,691,472.61	-2,016,624,512.34
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	3,843,732.03	4,770,176.96
减：二、费用		151,145,929.01	132,305,401.56
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	119,824,551.86	100,409,973.55
2.托管费	6.4.10.2.2	19,970,758.58	16,734,995.57
3.销售服务费	6.4.10.2.3	–	–
4.交易费用	6.4.7.19	11,199,193.13	14,943,988.93
5.利息支出		–	–
其中：卖出回购金融资产支出		–	–
6.税金及附加		2,533.76	6,392.16
7.其他费用	6.4.7.20	148,891.68	210,051.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,621,033,018.82	-1,041,478,691.34
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,621,033,018.82	-1,041,478,691.34

6.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全趋势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）	5,503,273,808.13	7,480,465,742.35	12,983,739,550.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	3,621,033,018.82	3,621,033,018.82
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）	568,906,198.10	1,117,917,805.53	1,686,824,003.63
其中：1.基金申购款	1,640,326,839.96	3,147,373,927.22	4,787,700,767.18
2.基金赎回款	-1,071,420,641.86	-2,029,456,121.69	-3,100,876,763.55
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）	6,072,180,006.23	12,219,416,566.70	18,291,596,572.93
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）	3,584,570,660.42	9,675,858,225.23	13,260,428,885.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-1,041,478,691.34	-1,041,478,691.34
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）	113,787,646.71	309,039,031.06	422,826,677.77
其中：1.基金申购款	1,175,817,357.36	3,191,785,581.62	4,367,602,938.98
2.基金赎回款	-1,062,029,710.65	-2,882,746,550.56	-3,944,776,261.21
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）	3,698,358,307.13	8,943,418,564.95	12,641,776,872.08

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______ ____詹鸿飞____
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

兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)(原名“兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)”)(以下简称“本基金”)，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2005]156号文)的核准，由兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》发售，基金合同于2005年11月3日生效。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为927,645,098.72份基金份额。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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为“兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、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)及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票资产30%-95%；固定收益类证券为0%-65%；现金或者到期日在一年内的政府债券不低于5%，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：沪深300指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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[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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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 [2008]1号文《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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《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]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以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。对基金在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自2013年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，按照证券投资基金管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(h) 对基金在2018年1月1日 (含) 以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

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
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

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	2,415,833,624.55	29.94%	1,859,505,289.36	15.99%

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	5,286,471.92	32.64%	28,953,961.53	11.61%

6.4.8.1.3债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	43,600,000.00	25.33%	–	–

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内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	1,771,640.84	27.83%	940,006.10	28.20%
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	1,362,048.26	16.15%	357,312.36	12.35%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

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	119,824,551.86	100,409,973.55
其中：支付销售机构的客户维护费	17,810,131.57	16,501,808.99

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	19,970,758.58	16,734,995.57

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本报告期及上年度可比期间基金管理人均无运用固有资金投资本基金的情况。

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
兴业银行	13,316,020.78	0.0549%	–	–

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
兴业银行	3,684,743,191.02	18,549,663.93	626,662,040.69	8,058,895.99

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于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
002798	帝欧家居	2018年1月19日	2020年1月22日	非公开发行流通受限	47.18	16.66	948,508	44,750,607.44	15,802,143.28	–
002798	帝欧家居	2018年5月18日	2020年1月22日	非公开发行流通受限－转增	–	16.66	663,955	–	11,061,490.30	1
002798	帝欧家居	2018年9月25日	2020年1月22日	非公开发行流通受限－转增	–	16.66	1,128,724	–	18,804,541.84	2
000553	安道麦A	2018年1月16日	2020年1月17日	非公开发行流通受限	14.90	9.97	4,026,868	60,000,333.20	40,147,873.96	3
002115	三维通信	2018年3月28日	2020年3月30日	非公开发行流通受限	8.34	10.65	2,341,267	19,526,166.78	24,934,493.55	–
002228	合兴包装	2017年11月17日	2019年11月20日	非公开发行流通受限	4.37	4.75	6,864,989	30,000,001.93	32,608,697.75	–
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	270,393	10,748,121.75	7,733,239.80	–
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	81,118	–	2,319,974.80	4
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	105,453	–	3,015,955.80	5
300482	万孚生物	2019年2月21日	2019年8月21日	大宗交易购入流通受限	26.84	36.10	900,000	24,156,000.00	32,490,000.00	–
600584	长电科技	2019年6月4日	2019年12月4日	大宗交易购入流通受限	13.20	11.58	11,000,000	145,200,000.00	127,380,000.00	–
600584	长电科技	2019年6月13日	2019年12月13日	大宗交易购入流通受限	12.63	11.53	3,800,000	47,994,000.00	43,814,000.00	–
603866	桃李面包	2019年1月9日	2019年7月9日	大宗交易购入流通受限	42.23	41.34	2,000,000	84,460,000.00	82,680,000.00	–
603866	桃李面包	2019年4月25日	2019年7月9日	大宗交易购入流通受限－转增	–	41.34	800,000	–	33,072,000.00	6
000100	TCL集团	2019年3月25日	2019年9月25日	大宗交易购入流通受限	3.64	3.22	10,070,000	36,654,800.00	32,425,400.00	–
002952	亚世光电	2019年3月20日	2020年3月30日	老股转让锁定	31.14	31.14	23,673	737,177.22	737,177.22	–
002952	亚世光电	2019年6月10日	2020年3月30日	老股转让锁定－转增	–	31.14	11,836	–	368,573.04	7
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	–
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	–

1、本基金持有的非公开发行股票帝欧家居，于2018年5月18日实施2017年年度权益分派方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币2.00元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增7股。本基金新增663,955股。

2、本基金持有的非公开发行股票帝欧家居，于2018年9月25日实施2018年半年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增7股。本基金新增1,128,724股。

3、经深圳交易所核准，公司证券简称自2019年1月10日起由“沙隆达A”变更为“安道麦A”。

4、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年年度权益分派方案，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81,118股。

5、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年年度权益分派方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币4.76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105,453股。

6、本基金持有的大宗交易购入股票桃李面包，于2019年4月25日实施2018年年度权益分派方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币1.00元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增4.00股。本基金新增800,000股。

7、本基金持有的老股转让股票亚世光电，于2019年6月10日实施2018年年度权益分派方案，向全体股东每10股送红股2.60股，派发现金股利人民币6.80元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增2.40股。本基金新增11,836股。

上述流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.9.2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股票。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1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。

6.4.9.3.2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。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

§7 投资组合报告

7.1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	14,485,037,780.10	78.82
	其中：股票	14,485,037,780.10	78.82
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	116,089,835.22	0.63
	其中：债券	116,089,835.22	0.63
	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	3,692,347,436.24	20.09
8	其他各项资产	83,738,891.61	0.46
9	合计	18,377,213,943.17	100.00

7.2期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	108,116,816.64	0.59
B	采矿业	403,598,091.02	2.21
C	制造业	7,618,825,270.37	41.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	106,073,872.76	0.58
E	建筑业	9,489,499.00	0.05
F	批发和零售业	1,764,203,645.97	9.64
G	交通运输、仓储和邮政业	89,971,003.12	0.49
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	257,527,314.16	1.41
J	金融业	1,793,788,154.07	9.81
K	房地产业	1,462,242,870.11	7.99
L	租赁和商务服务业	113,700,535.82	0.62
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	3,249,682.10	0.02
R	文化、体育和娱乐业	754,251,024.96	4.12
S	综合	–	–
	合计	14,485,037,780.10	79.19

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3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	601933	永辉超市	170,699,586	1,742,842,773.06	9.53
2	601318	中国平安	19,613,489	1,737,951,260.29	9.50
3	601012	隆基股份	63,420,806	1,465,654,826.66	8.01
4	600031	三一重工	105,293,806	1,377,242,982.48	7.53
5	600048	保利地产	92,974,951	1,186,360,374.76	6.49
6	300144	宋城演艺	31,591,592	731,029,438.88	4.00
7	002223	鱼跃医疗	28,092,560	691,638,827.20	3.78
8	600703	三安光电	55,254,308	623,268,594.24	3.41
9	600584	长电科技	41,129,396	509,526,738.60	2.79
10	601899	紫金矿业	100,301,165	378,135,392.05	2.07

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

7.4报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1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	600031	三一重工	581,744,997.68	4.48
2	600048	保利地产	433,960,412.00	3.34
3	000002	万 科A	260,688,809.10	2.01
4	601012	隆基股份	223,987,122.47	1.73
5	600584	长电科技	193,194,000.00	1.49
6	600703	三安光电	192,779,885.24	1.48
7	601318	中国平安	140,177,563.32	1.08
8	601933	永辉超市	136,975,179.96	1.05
9	601899	紫金矿业	129,976,418.00	1.00
10	002672	东江环保	112,336,879.49	0.87
11	600328	兰太实业	88,366,204.84	0.68
12	603866	桃李面包	84,460,000.00	0.65
13	002352	顺丰控股	60,172,575.41	0.46
14	600161	天坛生物	48,079,417.24	0.37
15	000100	TCL 集团	38,917,610.00	0.30
16	300271	华宇软件	35,943,369.05	0.28
17	600702	舍得酒业	31,490,096.30	0.24
18	603589	口子窖	27,874,637.20	0.21
19	600309	万华化学	25,982,601.02	0.20
20	300454	深信服	25,951,208.60	0.20

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。

7.4.2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	600703	三安光电	530,906,542.51	4.09
2	000858	五 粮 液	466,612,435.16	3.59
3	601100	恒立液压	348,781,446.24	2.69
4	601318	中国平安	321,552,118.96	2.48
5	601012	隆基股份	228,420,023.72	1.76
6	600584	长电科技	215,012,830.99	1.66
7	300170	汉得信息	213,597,921.90	1.65
8	002468	申通快递	140,084,175.89	1.08
9	601899	紫金矿业	137,875,196.66	1.06
10	300251	光线传媒	112,590,821.27	0.87
11	603899	晨光文具	102,735,114.91	0.79
12	601933	永辉超市	93,004,552.80	0.72
13	600161	天坛生物	54,745,577.24	0.42
14	603328	依顿电子	36,972,516.69	0.28
15	300271	华宇软件	32,268,952.75	0.25
16	002530	金财互联	31,759,248.68	0.24
17	601138	工业富联	29,884,744.13	0.23
18	002115	三维通信	29,646,550.76	0.23
19	000661	长春高新	23,391,240.00	0.18
20	600328	兰太实业	22,959,773.56	0.18

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。

7.4.3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	4,016,754,657.59
卖出股票收入（成交）总额	4,121,651,905.02

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。

7.5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	–	–
2	央行票据	–	–
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（可交换债）	116,089,835.22	0.63
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	116,089,835.22	0.63

7.6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

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	132015	18中油EB	792,880	77,615,023.20	0.42
2	132004	15国盛EB	158,690	15,635,725.70	0.09
3	128022	众信转债	123,154	12,275,990.72	0.07
4	132013	17宝武EB	98,300	9,824,102.00	0.05
5	110051	中天转债	7,030	738,993.60	0.00

7.7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。

7.8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贵金属投资明细

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9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。

7.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2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。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1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。

7.11.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.3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。

7.12投资组合报告附注

7.12.1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。

7.12.2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中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3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	1,876,249.78
2	应收证券清算款	6,577,988.69
3	应收股利	–
4	应收利息	1,999,979.94
5	应收申购款	73,284,673.20
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	83,738,891.61

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132015	18中油EB	77,615,023.20	0.42
2	132004	15国盛EB	15,635,725.70	0.09
3	128022	众信转债	12,275,990.72	0.07
4	132013	17宝武EB	9,824,102.00	0.05

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600584	长电科技	171,194,000.00	0.94	大宗流通受限

7.12.6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。

§8 基金份额持有人信息

8.1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
1,113,479	21,780.14	10,699,406,587.70	44.12%	13,552,326,949.34	55.88%

8.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	项宇涛	15,256,681.00	2.01%
2	卢清华	9,513,158.00	1.25%
3	深圳市美格莱特电子有限公司	6,630,941.00	0.87%
4	国信证券股份有限公司	4,026,970.00	0.53%
5	林兆升	3,775,800.00	0.50%
6	赵艳霞	3,725,262.00	0.49%
7	朱永勤	3,609,383.00	0.48%
8	童玲华	3,448,249.00	0.45%
9	邢艳	2,797,632.00	0.37%
10	冯学正	2,748,055.00	0.36%

注：持有人为LOF基金场内持有人。

8.3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
基金管理人所有从业人员持有本基金	27,352,253.64	0.1128%

8.4期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	〉100
本基金基金经理持有本开放式基金	〉100

注：本基金的基金经理也是本公司高级管理人员及研究部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年11月3日)基金份额总额	927,645,098.72
本报告期期初基金份额总额	21,979,566,375.63
本报告期期间基金总申购份额	6,551,347,543.27
减：本报告期期间基金总赎回份额	4,279,180,381.86
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–
本报告期期末基金份额总额	24,251,733,537.04

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。

§10 重大事件揭示

10.1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。

10.2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)报告期内基金管理人重大人事变动。

2019年4月12日公告，自2019年4月12日起詹鸿飞先生任公司副总经理暨首席信息官，严长胜先生任公司副总经理。

(2)报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

自2019年1月22日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

10.3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。

10.4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。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6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、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1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	
兴业证券	3	2,415,833,624.55	29.94%	1,771,640.84	27.83%	–
海通证券	2	1,292,853,362.34	16.02%	1,059,639.42	16.64%	–
申万宏源	1	1,032,579,183.47	12.80%	961,636.67	15.10%	–
天风证券	1	805,028,188.93	9.98%	508,220.92	7.98%	–
中信建投	2	703,204,786.90	8.72%	540,718.09	8.49%	–
方正证券	2	355,412,377.25	4.41%	224,372.32	3.52%	–
光大证券	1	320,454,282.79	3.97%	298,440.25	4.69%	–
华泰证券	1	297,102,605.23	3.68%	276,694.37	4.35%	–
中金公司	1	281,486,660.03	3.49%	262,153.40	4.12%	–
东方证券	1	272,635,187.33	3.38%	253,909.70	3.99%	–
中信证券	3	205,961,767.57	2.55%	130,024.24	2.04%	–
国金证券	1	85,332,623.18	1.06%	79,469.73	1.25%	–
山西证券	2	–	–	–	–	–
国海证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	1	–	–	–	–	–
金元证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	2	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
中银国际	1	–	–	–	–	–
东北证券	2	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
民生证券	2	–	–	–	–	–

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。

10.7.2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
兴业证券	5,286,471.92	32.64%	43,600,000.00	25.33%	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	40,500,000.00	23.53%	–	–
天风证券	7,076,709.40	43.69%	88,000,000.00	51.13%	–	–
中信建投	825,269.58	5.09%	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
光大证券	3,009,484.30	18.58%	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
山西证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	–	–	–	–
金元证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1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
–	–	–	–	–	–	–	–
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：1 、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴全基金管理有限公司
2019年8月24日