

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金  
(LOF)  
2017 年半年度报告 摘要

2017 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

送出日期：2017 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 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	兴全沪深 300 指数（LOF）
场内简称	兴全 300
基金主代码	163407
前端交易代码	163407
后端交易代码	163408
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2010 年 11 月 2 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
报告期末基金份额总额	552,834,675.80 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	2011 年 1 月 19 日

## 2.2 基金产品说明

投资目标	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%。
投资策略	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。
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，追求接近或超越沪深 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。

## 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	林葛
	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95599
传真		021-20398858	010-68121816

## 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	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	26,747,305.16
本期利润	102,770,155.76
加权平均基金份额本期利润	0.2404
本期基金份额净值增长率	16.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.6186
期末基金资产净值	894,799,270.94
期末基金份额净值	1.6186

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	6.03%	0.71%	4.73%	0.64%	1.30%	0.07%
过去三个月	9.46%	0.64%	5.80%	0.59%	3.66%	0.05%
过去六个月	16.04%	0.58%	10.24%	0.54%	5.80%	0.04%
过去一年	29.24%	0.64%	15.46%	0.63%	13.78%	0.01%
过去三年	111.58%	1.70%	66.04%	1.66%	45.54%	0.04%
自成立以来	61.86%	1.44%	6.52%	1.45%	55.34%	-0.01%

注：本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是沪深 300 指数，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：

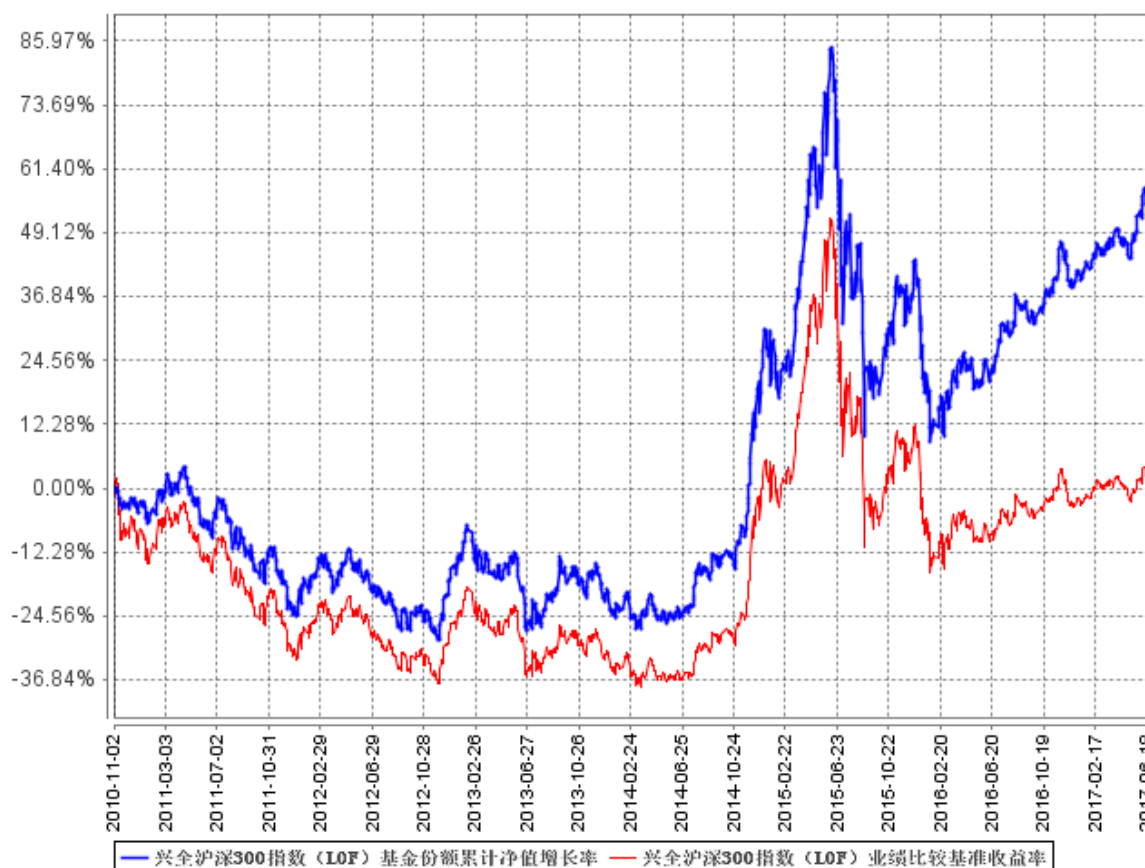
$$\text{Return } t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率 } t / 360)$$

$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

其中,  $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ,  $T$  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

兴全沪深300指数 (LOF) 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 2017 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。

## § 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 2017 年 6 月 30 日, 公司旗下管理着十八只基金, 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)、兴全保本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、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金。

#### 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		
申庆	本基金基金经理	2010 年 11 月 2 日	-	20 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、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 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

由于在今年年初就预判了价值投资和漂亮 50 会得到市场认可并持续强化的趋势，本基金通过提高行业和个股偏离度来加大相关板块的配置。具体操作上，本基金逐步、稳妥地加大了高分红板块的配置。行业配置上，体现人民消费水平提升的旅游服务行业，估值水平处于市场底端的银行、保险为代表的金融板块的配置比例提升幅度相对较大。建筑、地产、钢铁等周期性行业的配置有所降低，并进一步改善了行业内个股配置的结构。

本基金始终把降低净值波动风险放在首要位置，尽量将风险和收益平衡到最合理的状态。尽管本基金当前的行业与个股偏离度处于历史较高水平，但基金组合对应的相对估值水平和分红率处于历史最低水平。与同类产品相比偏离度水平是适中甚至是偏低的，因此总体风险是可控的。本基金小组将不断努力挖掘各种低风险的增加绝对收益和超额收益的机会，努力实现基金资产的

持续稳定增值。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为 16.04%，业绩比较基准收益率为 10.24%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

“去杠杆、抑制资产泡沫、防范经济金融风险”是当前经济和金融工作的重点，其目标是使经济、金融、投资更好地为实体经济和社会大众服务，使楼市、债市、股市回归基础性的市场定位，回归理性、回归价值。

资本市场的强监管势不可挡且始终在路上，显示出监管层不断完善监管制度、防范不当套利、维护市场公平、公正的坚定态度和决心。

各种监管举措有效地防范了大小非、机构等特定投资者利用信息优势、资金优势进行监管套利、内幕交易、操纵市值等行为。更加有效地引导投资者进行长期投资，价值投资，促进中长期 A 股市场更加健康、稳定、有序发展。

在这种背景下，由流动性泛滥所导致的 A 股高估值红利将进一步减少，过度投机机会减弱。A 股的估值会与成熟市场看齐，盈利水平、成长性、分红率等价值投资标准才是决定估值的核心要素。那些仅靠故事支撑估值的品种会面临着较为漫长且残酷的股价回归。

本基金始终秉承“勿以善小而不为、勿以恶小而为之”的传统哲学，通过价值投资、长期为投资者提供专业、有效的理财服务，同时借助兴全基金管理公司良好的投资文化和投研专业优势，持续挖掘各种低风险或无风险套利机会，积小胜为大胜、跬步至千里，以不断提升超额收益。

### 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有 3 年以上相关工作经验，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》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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**

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—兴全基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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**

本托管人认为，兴全基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，兴全基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		11,865,942.18	4,278,798.74
结算备付金		397,633.42	1,121,749.82
存出保证金		100,981.73	52,675.53
交易性金融资产		879,744,962.71	473,008,487.28
其中：股票投资		837,535,884.81	452,989,487.28
基金投资		-	-
债券投资		42,209,077.90	20,019,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		2,400,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		465,445.06	673,652.24
应收股利		-	-
应收申购款		4,882,596.60	359,336.24
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		899,857,561.70	479,494,699.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,835,990.99	521,637.48
应付赎回款		2,188,070.47	526,877.47
应付管理人报酬		535,362.82	325,988.31
应付托管费		100,380.52	61,122.81
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		197,311.37	81,459.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		201,174.59	43,123.97
负债合计		5,058,290.76	1,560,209.20
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		552,834,675.80	342,618,535.37
未分配利润		341,964,595.14	135,315,955.28
所有者权益合计		894,799,270.94	477,934,490.65
负债和所有者权益总计		899,857,561.70	479,494,699.85

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6186 元，基金份额总额 552,834,675.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		106,689,207.66	-37,425,029.27
1.利息收入		640,200.97	400,136.00
其中：存款利息收入		38,562.48	11,890.31
债券利息收入		493,999.91	375,053.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		107,638.58	13,192.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,777,098.07	10,121,369.07
其中：股票投资收益		22,445,377.96	6,743,336.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益		27,194.60	-81,969.49
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益		7,304,525.51	3,460,001.96
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		76,022,850.60	-48,004,996.54
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		249,058.02	58,462.20
<b>减: 二、费用</b>		3,919,051.90	2,353,813.09
1. 管理人报酬		2,480,146.62	1,472,823.06
2. 托管费		465,027.51	276,154.36
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		628,249.14	276,629.22
5. 利息支出		44,299.09	39,755.10
其中: 卖出回购金融资产支出		44,299.09	39,755.10
6. 其他费用		301,329.54	288,451.35
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		102,770,155.76	-39,778,842.36
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		102,770,155.76	-39,778,842.36

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	342,618,535.37	135,315,955.28	477,934,490.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	102,770,155.76	102,770,155.76
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)	210,216,140.43	103,878,484.10	314,094,624.53
其中: 1. 基金申购款	369,042,198.22	180,047,982.76	549,090,180.98

2. 基金赎回款	-158,826,057.79	-76,169,498.66	-234,995,556.45
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）	552,834,675.80	341,964,595.14	894,799,270.94
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	304,018,593.33	117,132,320.03	421,150,913.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-39,778,842.36	-39,778,842.36
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）	234,101.51	-554,998.65	-320,897.14
其中：1. 基金申购款	48,614,198.45	9,813,723.59	58,427,922.04
2. 基金赎回款	-48,380,096.94	-10,368,722.24	-58,748,819.18
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）	304,252,694.84	76,798,479.02	381,051,173.86

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  
基金管理人负责人

庄园芳  
主管会计工作负责人

詹鸿飞  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) (原名兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金 (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 [2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金 (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人募集，基金合同于 2010 年 11 月 2 日正式生效，首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)。

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。

本基金的业绩基准为：沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%。

#### **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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.4.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.4.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.4.3 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。

#### **6.4.5 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

(2) 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、债券免征营业税和增值税。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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

中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	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。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	574,970,912.61	100.00%	209,506,883.35	100.00%

#### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	21,146,219.04	100.00%	26,680.00	100.00%

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	722,700,000.00	100.00%	162,200,000.00	100.00%

#### 6.4.7.1.4 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。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元



关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	420,804.00	100.00%	196,886.47	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	154,016.89	100.00%	124,255.09	100.00%

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）。管理人因此从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。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,480,146.62	1,472,823.06
其中：支付销售机构的客户维护费	650,784.34	457,224.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 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×0.8%/当年天数。

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	465,027.51	276,154.36

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 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×0.15%/当年天数。

### 6.4.7.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费	本期
---------	----

各关联方名称	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

无。

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.7.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

### 6.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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
农业银行	11,865,942.18	29,831.34	3,712,500.99	8,808.90

### 6.4.7.6 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。

### 6.4.7.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.8.1 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

6.4.10.1.1 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
000413	东旭光电	2016 年 8 月	2017 年 8 月	非公开发行 流通受限	6.29	10.40	794,913	5,000,002.77	8,267,095.20	

		25 日	28 日							
002821	凯莱英	2016 年 11 月 11 日	2017 年 11 月 20 日	新股流 通受 限	30.53	72.97	21,409	653,616.77	1,562,214.73	-
002821	凯莱英	2017 年 6 月 14 日	2017 年 11 月 20 日	新股- 转增	-	72.97	21,409	-	1,562,214.73	注 1
002594	比亚迪	2016 年 7 月 22 日	2017 年 7 月 25 日	非公开 发行 流通受 限	57.40	49.95	22,648	1,299,995.20	1,131,267.60	-
603823	百合花	2016 年 12 月 9 日	2017 年 12 月 20 日	新股流 通受 限	10.60	21.18	36,764	389,698.40	778,661.52	-
002879	长缆科技	2017 年 6 月 5 日	2017 年 7 月 7 日	新股流 通受 限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017 年 6 月 15 日	2017 年 7 月 17 日	新股流 通受 限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 6 日	新股流 通受 限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 10 日	新股流 通受 限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017 年 6 月 26 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受 限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017 年 6 月 30 日	2017 年 7 月 12 日	新股流 通受 限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受 限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 5 日	新股流 通受 限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 23 日	2017 年 7 月 3 日	新股流 通受 限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

注 1: 本基金持有的凯莱英, 于 2017 年 6 月 14 日实施 2016 年度权益分配方案, 向全体股东每 10 股派 5 元 (含税), 同时以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股。本基金新增 21,409 股。

上述流通受限证券可流通日系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。

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600050	中国联通	2017 年 4 月 5 日	重大事项	7.47	2017 年 8 月 21 日	8.22	587,300	3,776,928.08	4,387,131.00	-
600795	国电电力	2017 年 6 月 5 日	重大事项	3.60	-	-	735,600	2,855,500.52	2,648,160.00	-
601088	中国神华	2017 年 6 月 5 日	重大事项	22.29	-	-	88,000	1,666,720.00	1,961,520.00	-
000100	TCL 集团	2017 年 4 月 21 日	重大事项	3.43	2017 年 7 月 26 日	3.72	424,800	1,035,655.61	1,457,064.00	-
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大事项	14.12	-	-	99,900	1,107,655.81	1,410,588.00	-
000061	农产品	2017 年 6 月 28 日	重大事项	9.06	-	-	50,700	428,603.25	459,342.00	-

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本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。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本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。

#### 6.4.9 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	837,535,884.81	93.07
	其中：股票	837,535,884.81	93.07
2	固定收益投资	42,209,077.90	4.69
	其中：债券	42,209,077.90	4.69
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	2,400,000.00	0.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,263,575.60	1.36
7	其他各项资产	5,449,023.39	0.61
8	合计	899,857,561.70	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	440,995.20	0.05
B	采矿业	29,573,187.24	3.31
C	制造业	215,297,019.32	24.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,112,230.46	3.48
E	建筑业	36,241,439.21	4.05
F	批发和零售业	18,536,159.36	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	23,086,793.17	2.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,861,537.24	2.11
J	金融业	355,013,071.46	39.68
K	房地产业	44,981,683.31	5.03
L	租赁和商务服务业	21,631,176.00	2.42
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,861,049.92	0.54
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	4,931,548.16	0.55

S	综合	-	-
	合计	804,567,890.05	89.92

## 7.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	3,671,920.00	0.41
C	制造业	22,484,245.71	2.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	656,124.46	0.07
E	建筑业	37,867.32	0.00
F	批发和零售业	787,812.51	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	227,585.80	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	204,602.52	0.02
J	金融业	284,838.00	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	459,342.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	30,178.20	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	3,009,777.92	0.34
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	1,113,700.32	0.12
S	综合	-	-
	合计	32,967,994.76	3.68

## 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

### 7.3.1 指数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

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	601318	中国平安	1,158,800	57,488,068.00	6.42

2	601601	中国太保	1,538,740	52,117,123.80	5.82
3	600036	招商银行	1,229,200	29,390,172.00	3.28
4	601166	兴业银行	1,588,800	26,787,168.00	2.99
5	000001	平安银行	2,538,800	23,839,332.00	2.66
6	600741	华域汽车	888,826	21,545,142.24	2.41
7	601888	中国国旅	674,400	20,326,416.00	2.27
8	600690	青岛海尔	1,318,138	19,837,976.90	2.22
9	601009	南京银行	1,688,840	18,931,896.40	2.12
10	600016	民生银行	2,288,800	18,813,936.00	2.10

### 7.3.2 积极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

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	000800	一汽轿车	518,000	5,268,060.00	0.59
2	002821	凯莱英	42,818	3,124,429.46	0.35
3	601200	上海环境	112,768	3,009,777.92	0.34
4	600873	梅花生物	530,034	3,005,292.78	0.34
5	002792	通宇通讯	58,000	2,008,540.00	0.22

## 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	601601	中国太保	33,524,397.80	7.01
2	601888	中国国旅	22,833,306.00	4.78
3	000001	平安银行	20,532,780.00	4.30
4	601318	中国平安	17,924,164.00	3.75
5	601166	兴业银行	16,425,060.00	3.44
6	601628	中国人寿	14,295,942.00	2.99
7	601336	新华保险	14,020,475.24	2.93
8	600741	华域汽车	12,669,865.22	2.65
9	601225	陕西煤业	12,442,558.00	2.60
10	600015	华夏银行	11,542,932.72	2.42

11	600016	民生银行	11,207,078.00	2.34
12	600000	浦发银行	11,006,425.00	2.30
13	601398	工商银行	10,467,172.00	2.19
14	601328	交通银行	10,137,956.00	2.12
15	601668	中国建筑	9,754,268.00	2.04
16	601009	南京银行	9,379,496.00	1.96
17	000895	双汇发展	8,725,215.29	1.83
18	600036	招商银行	8,601,675.48	1.80
19	601988	中国银行	8,165,368.00	1.71
20	601006	大秦铁路	7,517,569.00	1.57

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	601336	新华保险	14,365,251.36	3.01
2	601888	中国国旅	10,506,904.59	2.20
3	601088	中国神华	9,300,667.12	1.95
4	601225	陕西煤业	8,045,563.35	1.68
5	601398	工商银行	7,390,430.00	1.55
6	601318	中国平安	5,981,315.68	1.25
7	000709	河钢股份	5,259,239.00	1.10
8	600741	华域汽车	5,100,390.76	1.07
9	002241	歌尔股份	4,205,093.81	0.88
10	601601	中国太保	3,462,237.24	0.72
11	002791	坚朗五金	2,660,949.00	0.56
12	001979	招商蛇口	2,637,744.00	0.55
13	601166	兴业银行	2,326,807.00	0.49
14	600016	民生银行	2,304,669.00	0.48
15	002008	大族激光	2,060,992.00	0.43
16	300085	银之杰	1,873,100.00	0.39
17	601328	交通银行	1,750,105.55	0.37
18	600649	城投控股	1,748,000.77	0.37
19	600519	贵州茅台	1,690,186.07	0.35
20	600000	浦发银行	1,419,559.00	0.30

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	448,069,522.43
卖出股票收入（成交）总额	161,806,897.52

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	39,873,000.00	4.46
	其中：政策性金融债	39,873,000.00	4.46
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）	2,336,077.90	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,209,077.90	4.72

### 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	170401	17 农发 01	200,000	19,924,000.00	2.23
2	150406	15 农发 06	100,000	9,992,000.00	1.12
3	150414	15 农发 14	100,000	9,957,000.00	1.11
4	113011	光大转债	18,850	1,980,569.50	0.22
5	128015	久其转债	2,380	270,867.80	0.03

## **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。

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**

本基金本报告期末未持有贵金属。

## **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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

### **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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### **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

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	100,981.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	465,445.06
5	应收申购款	4,882,596.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,449,023.39

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 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。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五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	002821	凯莱英	3,124,429.46	0.35	新股锁定

### 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
37,809	14,621.77	239,638,749.47	43.35%	313,195,926.33	56.65%

### 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	周素菊	416,623.00	10.11%
2	高德荣	255,880.00	6.21%
3	王乐京	180,542.00	4.38%
4	裘海燕	135,024.00	3.27%
5	冯学正	124,826.00	3.03%
6	陈敏丽	105,400.00	2.56%
7	王菊萍	76,817.00	1.86%
8	易俐萍	67,003.00	1.63%
9	黄春生	61,100.00	1.48%
10	石春娥	60,006.00	1.46%

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	62,911.93	0.0114%

### 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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 11 月 2 日）基金份额总额	2,955,476,122.49
本报告期期初基金份额总额	342,618,535.37
本报告期基金总申购份额	369,042,198.22
减:本报告期基金总赎回份额	158,826,057.79
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	552,834,675.80

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。

2016 年 1 月 21 日公告，自 2016 年 1 月 19 日起，庄园芳女士代任公司总经理，杨东先生离任公司总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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——德勤华永会计师事务所（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	2	574,970,912.61	100.00%	420,804.00	100.00%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-

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	21,146,219.04	100.00%	722,700,000.00	100.00%	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-

## § 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
机构	1	2017 年 6 月 5 日-2017 年 6 月 30 日	0.00	131,172,689.71	0.00	131,172,689.71	23.73%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>单一投资人在某一时点集中大规模申购,会导致基金资产不能及时跟踪标的指数,若在指数上升过程中有可能摊薄基金净值的上升幅度,造成其他基金持有人的收益水平降低。</p> <p>持有比重较高的单一持有人在某一时间的集中赎回行为会造成基金总净值的快速下降。为应对较大单一持有人的赎回,基金管理人需在规定时间内快速减仓,从而对基金净值造成负面冲击。另外,基金持有人在某一天的大规模赎回可能会导致基金组合中的股票资产比例在短期内大幅上升,这会加剧基金净值的波动。相对其他集中持股的基金产品,指数基金投资组合的分散化程度高。面对大额赎回时指数基金管理人会通过程序化交易快速分散减仓,以降低大额赎回对净值波动的负面影响。</p>							

注: 1、“申购金额”包含分红再投资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  
2017 年 8 月 29 日