

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

2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 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

报告送出日期：2017 年 10 月 26 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴全新视野定期开放混合型发起式
场内简称	-
基金主代码	001511
交易代码	001511
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式（本基金以定期开放方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。）
基金合同生效日	2015 年 7 月 1 日
报告期末基金份额总额	6,343,445,869.40 份
投资目标	本基金通过精选基本面良好，具有盈利能力和市场竞争力的公司，同时通过灵活应用多种绝对收益策略，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例。本基金主要采用市场中性的投资策略，结合多种绝对收益策略，通过定量和定性相结合的方法精选个股，并运用股指期货实现套期保值，力争实现稳定的绝对回报。
业绩比较基准	年化收益率 6%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 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（2017年7月1日－2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	101,531,838.76
2. 本期利润	323,670,743.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0552
4. 期末基金资产净值	7,579,859,918.44
5. 期末基金份额净值	1.195

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。

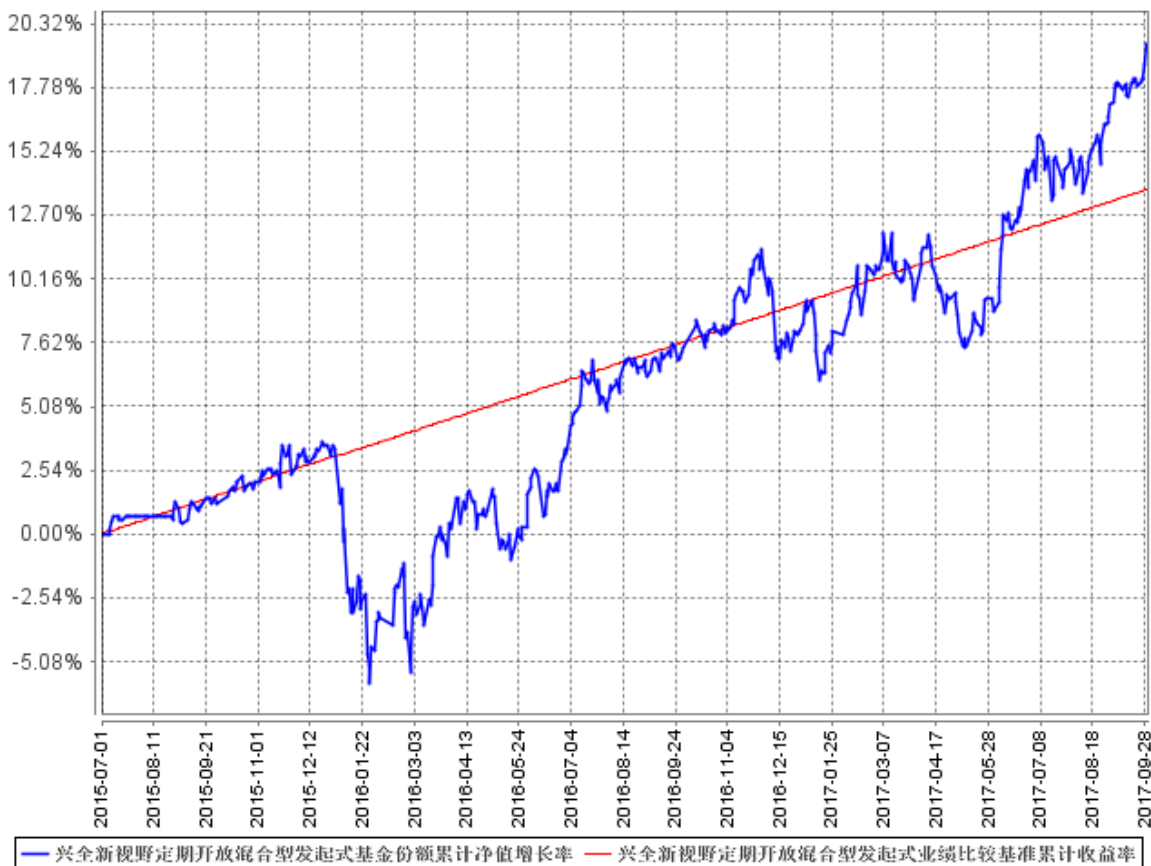
3.2 基金净值表现

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

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	4.46%	0.45%	1.37%	0.01%	3.09%	0.44%

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

兴全新视野定期开放混合型发起式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 9 月 30 日。

2、按照《兴全新视野定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2015 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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本基金投资组合的比例范围。

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		
董承非	副总经理、基金管理部投资总监，本基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2015 年 7 月 1 日	-	13 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。

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、《兴全新视野定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》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，本基金在相应的封闭期内符合《基金合同》约定的附加管理费提取条件。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 报告期内基金投资策略和运作分析

在上一个封闭期打开后，本基金的规模有所上升，导致原来的股票持仓比例下降。本基金新增了一些大消费和科技类股票的持仓，继续维持仓位到一个合理的水平。总体而言，这些新增的持仓给基金还是带来了一定的正收益。但是三季度本基金原来持有的一些成长股表现还是不如意，拖累了基金的表现。总体而言，本基金三季度的表现比前面两个季度稍微好些。

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 1.1950 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.46%，业绩比较基准收益率为 1.37%。

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	4,707,267,971.60	62.02
	其中：股票	4,707,267,971.60	62.02

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,808,575,030.06	23.83
	其中：债券	1,808,575,030.06	23.83
	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	485,961,528.94	6.40
	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	379,794,805.65	5.00
8	其他资产	207,956,674.86	2.74
9	合计	7,589,556,011.11	100.00

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	-	-
B	采矿业	39,793.60	0.00
C	制造业	2,486,551,195.59	32.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	169,354,156.83	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	89,385,197.90	1.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,954,426.45	2.43
J	金融业	833,373,473.46	10.99
K	房地产业	7,756,064.50	0.10
L	租赁和商务服务业	502,571,452.71	6.63
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	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	434,110,245.22	5.73
S	综合	-	-
	合计	4,707,267,971.60	62.10

5.2.2 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

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	8,999,919	487,435,613.04	6.43
2	002027	分众传媒	36,542,316	367,250,275.80	4.85
3	601601	中国太保	9,367,394	345,937,860.42	4.56
4	600887	伊利股份	11,499,904	316,247,360.00	4.17
5	300144	宋城演艺	16,031,349	300,106,853.28	3.96
6	601100	恒立液压	13,768,961	250,457,400.59	3.30
7	000858	五粮液	4,167,533	238,716,290.24	3.15
8	600060	海信电器	14,088,052	221,323,296.92	2.92
9	600703	三安光电	9,438,508	218,407,075.12	2.88
10	600584	长电科技	10,427,442	180,394,746.60	2.38

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,542,990,000.00	20.36
	其中：政策性金融债	1,542,990,000.00	20.36
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）	265,585,030.06	3.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,808,575,030.06	23.86

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	170207	17 国开 07	5,000,000	498,450,000.00	6.58
2	110235	11 国开 35	4,000,000	401,240,000.00	5.29
3	110237	11 国开 37	4,000,000	395,400,000.00	5.22
4	170308	17 进出 08	1,200,000	119,856,000.00	1.58

5	080208	08 国开 08	1,000,000	100,540,000.00	1.33
---	--------	----------	-----------	----------------	------

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

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC1710	IC1710	75	98,658,000.00	-327,960.00	套保
公允价值变动总额合计 (元)					-327,960.00
股指期货投资本期收益 (元)					1,542,280.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-327,960.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货套利策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。

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

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	23,948,456.79
2	应收证券清算款	167,713,407.98
3	应收股利	-
4	应收利息	16,294,810.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,956,674.86

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	110032	三一转债	75,726,045.20	1.00
2	132006	16 皖新 EB	73,481,945.60	0.97
3	117009	15 九洲债	40,344,000.00	0.53
4	117081	15 名轩 E2	23,303,062.76	0.31
5	137001	15 美克 EB	16,042,500.00	0.21
6	132004	15 国盛 EB	8,824,352.50	0.12

5.11.5 报告期末前十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	600584	长电科技	180,394,746.60	2.38	重大事项

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

报告期期初基金份额总额	4,712,936,479.37
报告期期间基金总申购份额	2,274,660,659.44
减：报告期期间基金总赎回份额	644,151,269.41
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	6,343,445,869.40

注：总申购份额含红利再投资、转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,750.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,750.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.16

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,750.00	0.16	10,000,750.00	0.16	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	4,999,525.00	0.08	4,999,525.00	0.08	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	15,000,275.00	0.24	15,000,275.00	0.24	3 年

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予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募集注册的文件；
- 2、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基金合同；
- 3、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托管协议；
- 4、关于申请募集注册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的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

兴全基金管理有限公司

2017 年 10 月 26 日