

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2019 年半年度报告

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

送出日期：2019 年 8 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

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 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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60

§11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)	
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	
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	1,751,397,359.15 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	
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
下属分级基金场内简称:	兴全 300	无
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	163407	-
下属分级基金的后端交易代码	163408	-
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

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, 仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

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。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。	
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
下属分级基金	本基金属于股票型基金, 预期	本基金属于股票型基金, 预期风险与预期

的风险收益特征	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。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。	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。
---------	---	---

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，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

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	杨卫东	贺倩
	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95599
传真		021-20398858	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		201204	100031
法定代表人		兰荣	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号

	C 类份额：兴全基金管理有限公司	C 类份额：上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼
--	------------------	--

§ 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

基金级别	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
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)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	63,283,770.29	706,286.01
本期利润	609,642,345.03	3,414,614.96
加权平均基金份额本期利润	0.4066	0.1405
本期加权平均净值利润率	22.35%	7.23%
本期基金份额净值增长率	27.57%	6.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,591,947,193.80	46,857,189.23
期末可供分配基金份额利润	0.9385	0.8496
期末基金资产净值	3,304,608,334.12	107,428,986.06
期末基金份额净值	1.9482	1.9478
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	94.82%	6.31%

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

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

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	5.34%	1.04%	5.13%	1.10%	0.21%	-0.06%
过去三个月	2.57%	1.43%	-1.10%	1.45%	3.67%	-0.02%
过去六个月	27.57%	1.43%	25.66%	1.47%	1.91%	-0.04%
过去一年	16.66%	1.43%	8.68%	1.45%	7.98%	-0.02%
过去三年	55.56%	1.05%	20.52%	1.05%	35.04%	0.00%

自基金合同生效起至今	94.82%	1.38%	11.19%	1.40%	83.63%	-0.02%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

兴全沪深 300 指数 C

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
自基金合同生效起至今	6.31%	1.09%	6.03%	1.16%	0.28%	-0.07%

注：1、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：

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

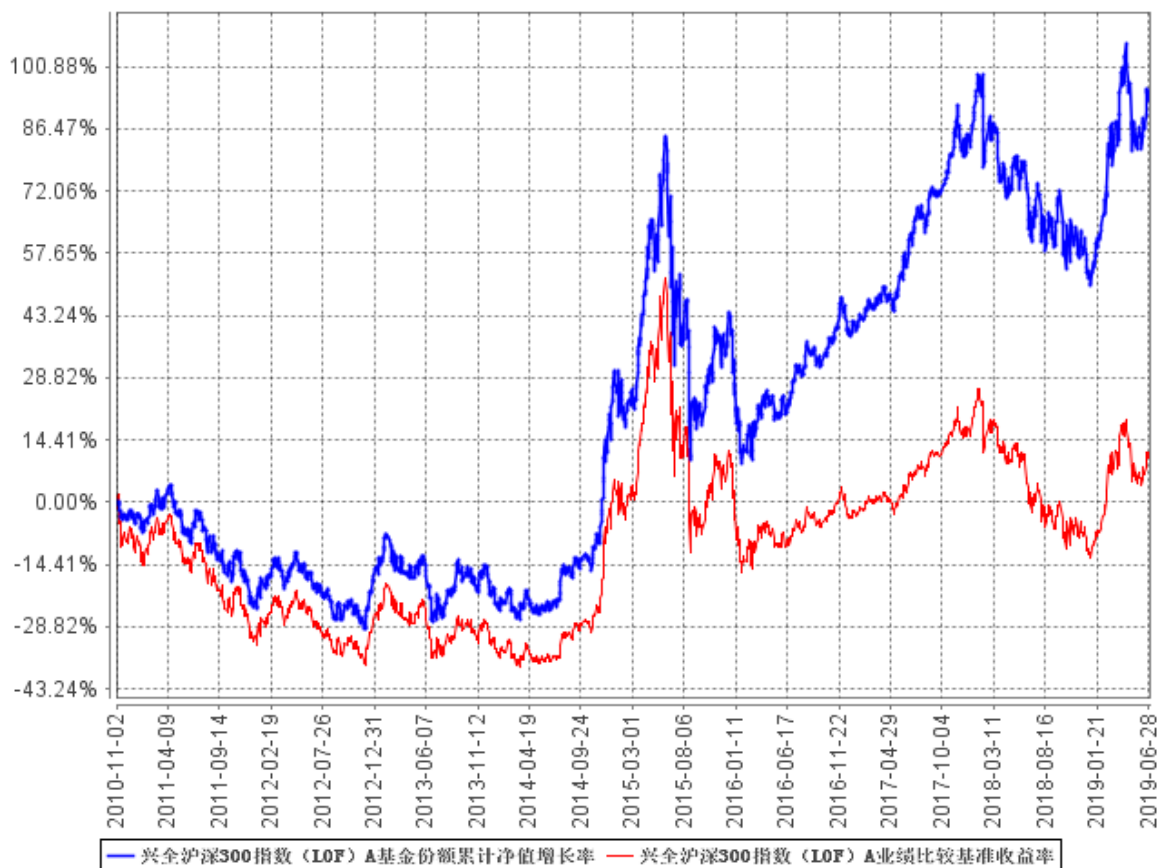
$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

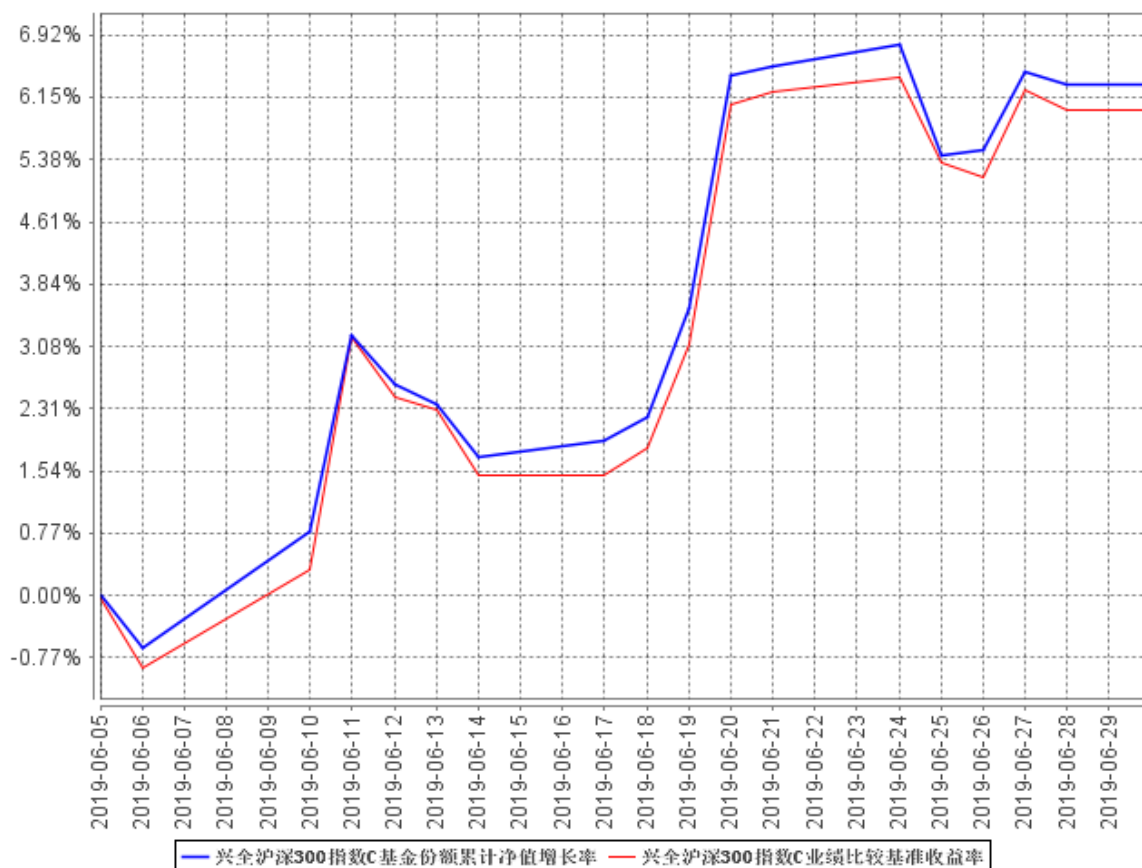
2、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额 (代码：007230)。详情请见管理人网站公告。

3.2.2 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) A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



兴全沪深300指数C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 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		
申庆	本基金、兴全恒益债券型证券	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

	投资基金基金经理				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。
张晓峰	本基金基金经理助理	2015 年 12 月 16 日	-	7 年	理学硕士，2011 年加入兴全基金管理有限公司，历任 FOF 投资与金融工程部研究员、固定收益部研究员。

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、考察是否存在不公平的因素。

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 A 股市场受多种因素影响，波动较大。一季度“业绩爆雷”指数表现抢眼，但二季度

得以修正。很多无厘头炒作的概念股、爆雷股、绩差，呈现从哪里来回那里去，并还在不断创出新低的道路上。相比之下，核心资产表现持续稳健向上，行业龙头公司上半年的相对和绝对收益均很显著，反映出 A 股市场自 2016 年以来的主导价值取向不可逆转，不断强化。本基金的权益组合始终坚持根据产品属性，在行业及风格合理分散的前提下，坚定持有那些估值安全，流动性较好的行业及龙头公司。在此基础上深入挖掘其他有特色，当前财务健康、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。

4.4.2 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 27.57%，同期业绩比较基准收益率为 25.66%；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%。（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）

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

监管部门的各项举措和上半年市场表现与我们近年来强调及长期坚持原则是吻合的，这进一步坚定了我们所秉持理念的信心，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过山车般的表演，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。

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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：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	2,144,417.96	24,118,044.44
结算备付金		6,423,150.97	1,663,562.80
存出保证金		354,902.58	551,776.04
交易性金融资产	6.4.7.2	3,509,195,787.37	2,010,400,547.72
其中：股票投资		3,198,149,710.57	1,846,225,652.93
基金投资		-	-
债券投资		311,046,076.80	164,174,894.79
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		1,090,385.91	131.20
应收利息	6.4.7.5	3,026,684.95	794,555.67
应收股利		-	-
应收申购款		10,770,531.59	5,739,876.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,533,005,861.33	2,043,268,494.33
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		99,225,000.00	1,000,000.00
应付证券清算款		885,191.35	12,188,785.65
应付赎回款		17,656,524.66	2,598,342.24
应付管理人报酬		2,104,193.67	1,309,990.13
应付托管费		394,536.33	245,623.15
应付销售服务费		12,318.97	-
应付交易费用	6.4.7.7	394,029.85	734,137.34
应交税费		1,461.73	842.95

应付利息		221.91	713.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	295,062.68	428,359.84
负债合计		120,968,541.15	18,506,794.70
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,751,397,359.15	1,325,805,454.82
未分配利润	6.4.7.10	1,660,639,961.03	698,956,244.81
所有者权益合计		3,412,037,320.18	2,024,761,699.63
负债和所有者权益总计		3,533,005,861.33	2,043,268,494.33

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，兴全沪深 300A 基金份额净值 1.9482 元，基金份额总额 1,696,243,125.13 份；兴全沪深 300C 基金份额净值 1.9478 元，基金份额总额 55,154,234.02 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：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		628,493,808.18	-167,320,087.33
1.利息收入		2,433,153.77	1,871,008.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	131,121.63	74,942.25
债券利息收入		2,285,807.95	1,702,240.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		16,224.19	93,825.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		74,544,164.31	33,229,064.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	36,536,141.37	16,377,664.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,625,187.94	115,628.06
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	35,382,835.00	16,735,771.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	549,066,903.69	-203,494,019.47
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	2,449,586.41	1,073,859.52
减：二、费用		15,436,848.19	8,932,055.12

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,817,873.93	6,475,887.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,028,351.37	1,214,228.99
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,318.97	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,178,529.33	725,206.27
5. 利息支出		1,035,254.15	188,637.21
其中: 卖出回购金融资产支出		1,035,254.15	188,637.21
6. 税金及附加		849.95	306.20
7. 其他费用	6.4.7.20	363,670.49	327,788.87
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		613,056,959.99	-176,252,142.45
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		613,056,959.99	-176,252,142.45

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: 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)	1,325,805,454.82	698,956,244.81	2,024,761,699.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	613,056,959.99	613,056,959.99
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)	425,591,904.33	348,626,756.23	774,218,660.56
其中: 1. 基金申购款	1,348,475,264.31	1,117,157,071.85	2,465,632,336.16
2. 基金赎回款	-922,883,359.98	-768,530,315.62	-1,691,413,675.60
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)	1,751,397,359.15	1,660,639,961.03	3,412,037,320.18

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)	734,976,877.78	616,600,357.20	1,351,577,234.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-176,252,142.45	-176,252,142.45
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)	218,140,015.60	198,236,332.58	416,376,348.18
其中：1.基金申购款	711,152,828.75	601,090,023.72	1,312,242,852.47
2.基金赎回款	-493,012,813.15	-402,853,691.14	-895,866,504.29
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)	953,116,893.38	638,584,547.33	1,591,701,440.71

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)。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, 仅 A 类份额上市交易。

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%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 \times 95%+同业存款利率 \times 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,144,417.96
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	2,144,417.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,815,228,941.20	3,198,149,710.57	382,920,769.37
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	186,530,846.22	190,742,076.80
	银行间市场	120,194,160.00	120,304,000.00
	合计	306,725,006.22	311,046,076.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,121,953,947.42	3,509,195,787.37	387,241,839.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	7,984.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	2,890.40
应收债券利息	3,015,650.79
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	159.70
合计	3,026,684.95

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	389,961.40
银行间市场应付交易费用	4,068.45
合计	394,029.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	61,083.87
应付指数使用费	121,479.99
预提审计费	27,769.02
预提信息披露费	84,729.80
其他	-
合计	295,062.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A	
项目	本期

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,325,805,454.82	1,325,805,454.82
本期申购	1,293,220,431.07	1,293,220,431.07
本期赎回(以“-”号填列)	-922,782,760.76	-922,782,760.76
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,696,243,125.13	1,696,243,125.13

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 C		
项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	55,254,833.24	55,254,833.24
本期赎回(以“-”号填列)	-100,599.22	-100,599.22
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	55,154,234.02	55,154,234.02

注：1、申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

2、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。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,191,460,238.14	-492,503,993.33	698,956,244.81
本期利润	63,283,770.29	546,358,574.74	609,642,345.03
本期基金份额交易产生的变动数	337,203,185.37	-37,436,566.22	299,766,619.15
其中：基金申购款	1,174,592,681.83	-106,391,240.17	1,068,201,441.66
基金赎回款	-837,389,496.46	68,954,673.95	-768,434,822.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,591,947,193.80	16,418,015.19	1,608,365,208.99

单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	706,286.01	2,708,328.95	3,414,614.96
本期基金份额交易产生的变动数	46,150,903.22	2,709,233.86	48,860,137.08
其中：基金申购款	46,236,130.74	2,719,499.45	48,955,630.19
基金赎回款	-85,227.52	-10,265.59	-95,493.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,857,189.23	5,417,562.81	52,274,752.04

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。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	64,007.13
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	36,007.04
其他	31,107.46
合计	131,121.63

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	263,332,054.75
减：卖出股票成本总额	226,795,913.38
买卖股票差价收入	36,536,141.37

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,625,187.94
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,625,187.94

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,124,055.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,472,099.23
减：应收利息总额	26,768.19
买卖债券差价收入	2,625,187.94

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	35,382,835.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	35,382,835.00

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	549,066,903.69
——股票投资	544,447,392.76
——债券投资	4,619,510.93
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	549,066,903.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,427,331.96
转换费收入	22,254.45
合计	2,449,586.41

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,177,829.33
银行间市场交易费用	700.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,178,529.33

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	27,769.02
信息披露费	84,729.80
账户维护费用	18,600.00
指数使用费	216,357.49
银行费用	16,214.18
上市费用	-
其他	-
合计	363,670.49

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、基金注册登记机构（C类份额）
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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	1,182,613,403.25	100.00%	697,396,333.13	100.00%

6.4.10.1.2 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	68,487,184.90	100.00%	92,734,528.87	100.00%

6.4.10.1.3 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	4,202,487,000.00	100.00%	1,193,654,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

		量的比例		总额的比例
兴业证券	866,840.75	100.00%	389,961.40	100.00%
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	510,610.68	100.00%	194,164.48	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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	10,817,873.93	6,475,887.58
其中：支付销售机构的客户维护费	2,903,136.52	1,589,014.38

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。

6.4.10.2.2 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	2,028,351.37	1,214,228.99

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴全基金	-	11,981.27	11,981.27
合计	-	11,981.27	11,981.27
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴全基金	-	-	-
合计	-	-	-

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。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×年销售服务费率/当年天数。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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
农业银行	2,144,417.96	64,007.13	6,552,221.17	49,292.78

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末 (2019 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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
002773	康弘药业	2019年2月12日	2019年8月12日	大宗交易购入流通受限	36.10	31.95	447,000	16,136,700.00	14,281,650.00	-
002773	康弘药业	2019年2月15日	2019年8月15日	大宗交易购入流通受限	36.65	31.86	300,000	10,995,000.00	9,558,000.00	-
002773	康弘药业	2019年3月4日	2019年9月4日	大宗交易购入流通受限	36.80	31.34	150,000	5,520,000.00	4,701,000.00	-
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年8月12日	大宗交易购入流通受限-转增	-	31.95	134,100	-	4,284,495.00	注1
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年8月15日	大宗交易购入流通受限-	-	31.86	90,000	-	2,867,400.00	注1

				转增						
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年9月4日	大宗交易购入流通受限-转增	-	31.34	45,000	-	1,410,300.00	注 1
601838	成都银行	2019年4月25日	2019年10月25日	大宗交易购入流通受限	8.70	8.51	2,300,000	20,010,000.00	19,573,000.00	-
601838	成都银行	2019年4月18日	2019年10月18日	大宗交易购入流通受限	8.80	8.57	1,500,000	13,200,000.00	12,855,000.00	-
000100	TCL集团	2019年3月22日	2019年9月23日	大宗交易购入流通受限	3.43	3.22	5,800,000	19,894,000.00	18,676,000.00	-
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	3,380,000	12,303,200.00	10,883,600.00	-
002555	三七互娱	2019年6月5日	2019年12月5日	大宗交易购入流通受限	10.74	12.57	1,000,000	10,740,000.00	12,570,000.00	-
002555	三七互娱	2019年6月10日	2019年12月10日	大宗交易购入流通受限	10.82	12.57	1,000,000	10,820,000.00	12,570,000.00	-
601200	上海环境	2019年6月20日	2019年12月20日	大宗交易购入流通受限	11.03	12.74	1,000,000	11,030,000.00	12,740,000.00	-
601200	上海环境	2019年6月	2019年12	大宗交易	11.88	12.74	500,000	5,940,000.00	6,370,000.00	-

		21 日	月 23 日	购入 流通 受限							
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	572,082	2,499,998.34	2,717,389.50	-	
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	注 2	
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	-	

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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: 张)	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
113537	文灿 转债	2019 年 6 月 12 日	2019 年 7 月 5 日	新发行 未上市	100.00	100.00	7,420	742,000.00	742,000.00	-
113028	环境 转债	2019 年 6 月 20 日	2019 年 7 月 8 日	新发行 未上市	100.00	100.00	3,060	306,000.00	306,000.00	-
113028	环境 转债	2019 年 6 月 19 日	2019 年 7 月 8 日	新发行 未上市	100.00	100.00	3,480	348,000.00	348,000.00	-
113027	华钰 转债	2019 年 6 月 18 日	2019 年 7 月 10 日	新发行 未上市	100.00	100.00	4,120	412,000.00	412,000.00	-
113027	华钰 转债	2019 年 6 月 19 日	2019 年 7 月	新发行 未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-

		日	10 日							
123026	中环转债	2019 年 6 月 10 日	2019 年 7 月 1 日	新发行未上市	100.00	100.00	29	2,900.00	2,900.00	-

注 1: 本基金持有的大宗交易购入股票康弘药业, 于 2019 年 6 月 6 日实施 2018 年年度权益分配方案, 向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 2.80 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 269,100 股。

注 2: 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 年年度权益分配方案, 向全体股东每 10 股送红股 2.6 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 2.4 股。本基金新增 11,836 股。

注 3: 流通受限证券可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。

6.4.12.2 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的流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 99,225,000.00 元, 于 2019 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的证券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金

融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,144,417.96	-	-	-	-	-	2,144,417.96
结算备付金	6,423,150.97	-	-	-	-	-	6,423,150.97
存出保证金	354,902.58	-	-	-	-	-	354,902.58
交易性金融资产	10,006,000.00	9,995,000.00	162,641,863.40	69,399,194.93	59,004,018.47	3,198,149,710.57	3,509,195,787.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,090,385.91	1,090,385.91
应收利息	-	-	-	-	-	3,026,684.95	3,026,684.95
应收申购款	397,515.87	-	-	-	-	10,373,015.72	10,770,531.59
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,325,987.38	9,995,000.00	162,641,863.40	69,399,194.93	59,004,018.47	3,212,639,797.15	3,533,005,861.33
负债							
卖出回购金融资产款	99,225,000.00	-	-	-	-	-	99,225,000.00
应付证券清	-	-	-	-	-	885,191.35	885,191.35

算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	17,656,524.66	17,656,524.66
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	2,104,193.67	2,104,193.67
应付托管费	-	-	-	-	-	394,536.33	394,536.33
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	12,318.97	12,318.97
应付交易费 用	-	-	-	-	-	394,029.85	394,029.85
应交税费	-	-	-	-	-	1,461.73	1,461.73
应付利息	-	-	-	-	-	221.91	221.91
其他负债	-	-	-	-	-	295,062.68	295,062.68
负债总计	99,225,000.00	-	-	-	-	21,743,541.15	120,968,541.15
利率敏感度 缺口	-79,899,012.62	9,995,000.00	162,641,863.40	69,399,194.93	59,004,018.47	3,190,896,256.00	3,412,037,320.18
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	24,118,044.44	-	-	-	-	-	24,118,044.44
结算备付金	1,663,562.80	-	-	-	-	-	1,663,562.80
存出保证金	551,776.04	-	-	-	-	-	551,776.04
交易性金融 资产	-	-	111,539,875.80	29,739,754.06	22,895,264.93	1,846,225,652.93	2,010,400,547.72
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	131.20	131.20
应收利息	-	-	-	-	-	794,555.67	794,555.67
应收申购款	234,807.74	-	-	-	-	5,505,068.72	5,739,876.46
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,568,191.02	-	111,539,875.80	29,739,754.06	22,895,264.93	1,852,525,408.52	2,043,268,494.33
负债							
卖出回购金 融资产款	1,000,000.00	-	-	-	-	-	1,000,000.00
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	12,188,785.65	12,188,785.65
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,598,342.24	2,598,342.24
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	1,309,990.13	1,309,990.13
应付托管费	-	-	-	-	-	245,623.15	245,623.15
应付交易费 用	-	-	-	-	-	734,137.34	734,137.34
应交税费	-	-	-	-	-	842.95	842.95
应付利息	-	-	-	-	-	713.40	713.40

其他负债	-	-	-	-	-	428,359.84	428,359.84
负债总计	1,000,000.00	-	-	-	-	17,506,794.70	18,506,794.70
利率敏感度缺口	25,568,191.02	-111,539,875.80	29,739,754.06	22,895,264.93	1,835,018,613.82	2,024,761,699.63	

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2019年6月30日)	上年度末(2018年12月31日)
	利率 +1%	-823,926.54	-874,668.05
	利率 -1%	832,459.46	888,204.48

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例范围为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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,198,149,710.57	93.73	1,846,225,652.93	91.18
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	311,046,076.80	9.12	164,174,894.79	8.11
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,509,195,787.37	102.85	2,010,400,547.72	99.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准 +10%	324,184,070.67	193,437,223.93
	业绩比较基准 -10%	-324,184,070.67	-193,437,223.93

注: 本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析, 反映了在其他变量不变的假设下, 证券投资价格发生合理、可能的变动时, 将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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	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	其他各项资产	15,242,505.03	0.43
9	合计	3,533,005,861.33	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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	105,818,420.16	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	68,116,692.34	2.00
E	建筑业	81,866,171.02	2.40
F	批发和零售业	36,853,195.90	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	126,638,468.38	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

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（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

7.2.3 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所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	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
11	601328	交通银行	11,668,800	71,413,056.00	2.09
12	000895	双汇发展	2,798,800	69,662,132.00	2.04
13	601997	贵阳银行	7,088,820	61,318,293.00	1.80
14	001979	招商蛇口	2,870,459	59,992,593.10	1.76
15	600309	万华化学	1,288,850	55,149,891.50	1.62
16	000333	美的集团	1,042,811	54,080,178.46	1.58
17	600000	浦发银行	3,998,889	46,707,023.52	1.37
18	000858	五粮液	369,482	43,580,401.90	1.28
19	600050	中国联通	6,888,800	42,435,008.00	1.24
20	000100	TCL 集团	12,568,000	40,841,640.00	1.20
21	601628	中国人寿	1,418,089	40,160,280.48	1.18
22	600009	上海机场	472,900	39,619,562.00	1.16
23	601398	工商银行	6,338,800	37,335,532.00	1.09
24	002773	康弘药业	1,166,100	37,102,845.00	1.09
25	601225	陕西煤业	3,801,000	35,121,240.00	1.03
26	601838	成都银行	4,100,000	35,077,000.00	1.03
27	601988	中国银行	9,188,800	34,366,112.00	1.01
28	000001	平安银行	2,438,800	33,606,664.00	0.98
29	000651	格力电器	600,618	33,033,990.00	0.97
30	600276	恒瑞医药	470,364	31,044,024.00	0.91
31	601088	中国神华	1,518,800	30,953,144.00	0.91
32	601668	中国建筑	4,795,800	27,575,850.00	0.81
33	600016	民生银行	4,326,610	27,473,973.50	0.81

34	002555	三七互娱	2,000,000	25,140,000.00	0.74
35	601006	大秦铁路	2,938,805	23,774,932.45	0.70
36	601169	北京银行	3,978,800	23,514,708.00	0.69
37	600585	海螺水泥	558,857	23,192,565.50	0.68
38	600900	长江电力	1,207,000	21,605,300.00	0.63
39	600637	东方明珠	1,937,797	20,424,380.38	0.60
40	600048	保利地产	1,588,800	20,273,088.00	0.59
41	600019	宝钢股份	3,118,880	20,272,720.00	0.59
42	000063	中兴通讯	623,141	20,270,776.73	0.59
43	000568	泸州老窖	247,922	20,039,535.26	0.59
44	600383	金地集团	1,588,000	18,944,840.00	0.56
45	000069	华侨城 A	2,688,844	18,687,465.80	0.55
46	600028	中国石化	3,338,885	18,263,700.95	0.54
47	601607	上海医药	978,800	17,765,220.00	0.52
48	601985	中国核电	3,098,800	17,229,328.00	0.50
49	600015	华夏银行	2,138,800	16,468,760.00	0.48
50	600674	川投能源	1,778,800	15,831,320.00	0.46
51	600170	上海建工	3,998,811	15,035,529.36	0.44
52	300070	碧水源	1,838,800	14,324,252.00	0.42
53	002142	宁波银行	589,800	14,296,752.00	0.42
54	603156	养元饮品	380,332	14,102,710.56	0.41
55	601939	建设银行	1,778,800	13,234,272.00	0.39
56	600406	国电南瑞	698,800	13,025,632.00	0.38
57	600104	上汽集团	508,800	12,974,400.00	0.38
58	601818	光大银行	3,388,600	12,910,566.00	0.38
59	000423	东阿阿胶	298,889	11,901,759.98	0.35
60	601390	中国中铁	1,768,800	11,532,576.00	0.34
61	000157	中联重科	1,878,870	11,292,008.70	0.33
62	000338	潍柴动力	887,100	10,902,459.00	0.32
63	002739	万达电影	588,800	10,857,472.00	0.32
64	601186	中国铁建	1,088,815	10,833,709.25	0.32
65	601899	紫金矿业	2,838,833	10,702,400.41	0.31
66	600436	片仔癀	78,800	9,077,760.00	0.27
67	002468	申通快递	358,998	8,953,410.12	0.26
68	000876	新希望	498,800	8,664,156.00	0.25
69	600535	天士力	463,720	7,674,566.00	0.22
70	600704	物产中大	1,288,824	6,985,426.08	0.20
71	300024	机器人	448,800	6,835,224.00	0.20
72	600660	福耀玻璃	298,800	6,791,724.00	0.20

73	601800	中国交建	588,800	6,665,216.00	0.20
74	300124	汇川技术	288,300	6,604,953.00	0.19
75	000768	中航飞机	418,821	6,596,430.75	0.19
76	000625	长安汽车	988,800	6,555,744.00	0.19
77	600196	复星医药	258,800	6,547,640.00	0.19
78	600795	国电电力	2,518,800	6,397,752.00	0.19
79	600977	中国电影	406,200	6,361,092.00	0.19
80	600332	白云山	152,700	6,256,119.00	0.18
81	000538	云南白药	72,852	6,077,313.84	0.18
82	600221	海航控股	2,918,500	5,924,555.00	0.17
83	600893	航发动力	258,824	5,877,893.04	0.17
84	600372	中航电子	388,800	5,769,792.00	0.17
85	601600	中国铝业	1,455,200	5,704,384.00	0.17
86	600089	特变电工	778,808	5,646,358.00	0.17
87	000402	金融街	718,800	5,635,392.00	0.17
88	002007	华兰生物	181,500	5,533,935.00	0.16
89	600018	上港集团	767,239	5,232,569.98	0.15
90	601012	隆基股份	225,700	5,215,927.00	0.15
91	300144	宋城演艺	224,100	5,185,674.00	0.15
92	600233	圆通速递	418,500	5,160,105.00	0.15
93	600498	烽火通信	182,223	5,076,732.78	0.15
94	600153	建发股份	558,900	4,963,032.00	0.15
95	002202	金风科技	395,723	4,918,836.89	0.14
96	600362	江西铜业	309,713	4,874,882.62	0.14
97	601138	工业富联	398,404	4,800,768.20	0.14
98	600066	宇通客车	368,000	4,791,360.00	0.14
99	601117	中国化学	788,845	4,748,846.90	0.14
100	600271	航天信息	198,800	4,582,340.00	0.13
101	600038	中直股份	108,868	4,465,765.36	0.13
102	600100	同方股份	484,879	4,388,154.95	0.13
103	600030	中信证券	182,700	4,350,087.00	0.13
104	600926	杭州银行	509,354	4,242,918.82	0.12
105	000630	铜陵有色	1,688,800	4,154,448.00	0.12
106	600688	上海石化	800,898	4,132,633.68	0.12
107	600085	同仁堂	138,920	4,028,680.00	0.12
108	600068	葛洲坝	643,537	4,009,235.51	0.12
109	000725	京东方 A	1,158,070	3,983,760.80	0.12
110	000898	鞍钢股份	1,012,553	3,837,575.87	0.11
111	002008	大族激光	108,500	3,730,230.00	0.11

112	601111	中国国航	388,800	3,720,816.00	0.11
113	601998	中信银行	589,919	3,521,816.43	0.10
114	002027	分众传媒	645,876	3,416,684.04	0.10
115	600886	国投电力	431,400	3,351,978.00	0.10
116	600004	白云机场	179,917	3,274,489.40	0.10
117	600188	兖州煤业	298,800	3,247,956.00	0.10
118	600219	南山铝业	1,410,400	3,187,504.00	0.09
119	601229	上海银行	268,820	3,185,517.00	0.09
120	600208	新湖中宝	988,882	3,105,089.48	0.09
121	601992	金隅集团	775,700	2,916,632.00	0.09
122	600118	中国卫星	128,803	2,904,507.65	0.09
123	002024	苏宁易购	239,900	2,754,052.00	0.08
124	601021	春秋航空	58,687	2,640,915.00	0.08
125	601633	长城汽车	318,800	2,636,476.00	0.08
126	000425	徐工机械	580,800	2,590,368.00	0.08
127	601688	华泰证券	108,000	2,410,560.00	0.07
128	002153	石基信息	66,000	2,388,540.00	0.07
129	002601	龙麟佰利	158,852	2,355,775.16	0.07
130	002925	盈趣科技	59,853	2,334,865.53	0.07
131	600023	浙能电力	518,927	2,293,657.34	0.07
132	600547	山东黄金	55,000	2,264,350.00	0.07
133	002271	东方雨虹	95,600	2,166,296.00	0.06
134	601933	永辉超市	202,662	2,069,179.02	0.06
135	000776	广发证券	129,400	1,777,956.00	0.05
136	000938	紫光股份	60,200	1,640,450.00	0.05
137	000408	藏格控股	195,700	1,618,439.00	0.05
138	601898	中煤能源	332,196	1,594,540.80	0.05
139	600177	雅戈尔	245,840	1,561,084.00	0.05
140	002241	歌尔股份	169,173	1,503,947.97	0.04
141	600415	小商品城	362,200	1,492,264.00	0.04
142	002594	比亚迪	27,948	1,417,522.56	0.04
143	600011	华能国际	225,900	1,407,357.00	0.04
144	000963	华东医药	53,705	1,394,181.80	0.04
145	601857	中国石油	199,000	1,369,120.00	0.04
146	000709	河钢股份	457,800	1,368,822.00	0.04
147	603993	洛阳钼业	336,800	1,333,728.00	0.04
148	601766	中国中车	158,300	1,280,647.00	0.04
149	600999	招商证券	74,732	1,277,169.88	0.04
150	600588	用友网络	43,264	1,162,936.32	0.03

151	601877	正泰电器	44,700	1,032,123.00	0.03
152	600583	海油工程	172,900	968,240.00	0.03
153	600297	广汇汽车	206,750	922,105.00	0.03
154	600482	中国动力	35,400	836,148.00	0.02
155	002236	大华股份	51,116	742,204.32	0.02
156	601669	中国电建	128,100	677,649.00	0.02
157	300122	智飞生物	13,900	599,090.00	0.02
158	002065	东华软件	85,146	595,170.54	0.02
159	300251	光线传媒	86,800	590,240.00	0.02
160	000728	国元证券	61,905	567,668.85	0.02
161	601618	中国中冶	150,200	456,608.00	0.01
162	603259	药明康德	4,741	410,949.88	0.01
163	600031	三一重工	29,241	382,472.28	0.01
164	002938	鹏鼎控股	11,980	351,732.80	0.01
165	002081	金螳螂	32,100	330,951.00	0.01
166	603833	欧派家居	2,929	315,218.98	0.01
167	601018	宁波港	64,618	283,673.02	0.01
168	000415	渤海租赁	69,800	273,616.00	0.01
169	601828	美凯龙	16,005	194,460.75	0.01
170	603260	合盛硅业	3,296	155,109.76	0.00

7.3.2 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所有股票投资明细

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	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
6	000800	一汽轿车	538,000	5,293,920.00	0.16
7	600873	梅花生物	858,834	4,113,814.86	0.12
8	002228	合兴包装	808,000	3,904,057.04	0.11
9	000792	*ST 盐湖	478,800	2,949,408.00	0.09
10	601333	广深铁路	808,900	2,612,747.00	0.08
11	000826	启迪环境	158,800	1,872,252.00	0.05
12	600376	首开股份	199,863	1,784,776.59	0.05
13	600395	盘江股份	288,800	1,706,808.00	0.05

14	600739	辽宁成大	116,325	1,691,365.50	0.05
15	600649	城投控股	261,400	1,691,258.00	0.05
16	000060	中金岭南	345,700	1,621,333.00	0.05
17	600827	百联股份	156,183	1,532,155.23	0.04
18	000623	吉林敖东	83,784	1,373,219.76	0.04
19	600549	厦门钨业	92,270	1,320,383.70	0.04
20	600820	隧道股份	185,700	1,171,767.00	0.03
21	002952	亚世光电	35,509	1,105,750.26	0.03
22	601118	海南橡胶	202,440	1,042,566.00	0.03
23	000046	泛海控股	185,800	1,036,764.00	0.03
24	300760	迈瑞医疗	4,800	783,360.00	0.02
25	000937	冀中能源	188,800	728,768.00	0.02
26	601168	西部矿业	100,000	638,000.00	0.02
27	600737	中粮糖业	72,300	627,564.00	0.02
28	000738	航发控制	46,700	625,780.00	0.02
29	000839	中信国安	155,050	623,301.00	0.02
30	600718	东软集团	47,475	608,629.50	0.02
31	000917	电广传媒	86,153	605,655.59	0.02
32	600150	中国船舶	24,300	573,480.00	0.02
33	600875	东方电气	47,316	502,495.92	0.01
34	600804	鹏博士	58,041	436,468.32	0.01
35	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
36	601928	凤凰传媒	40,007	322,856.49	0.01
37	600060	海信电器	34,201	294,812.62	0.01
38	600685	中船防务	18,800	283,128.00	0.01
39	000061	农产品	50,700	274,794.00	0.01
40	601866	中远海发	97,300	264,656.00	0.01
41	300713	英可瑞	18,921	258,460.86	0.01
42	000793	华闻传媒	76,393	256,680.48	0.01
43	600037	歌华有线	23,900	244,975.00	0.01
44	002860	星帅尔	11,970	231,978.60	0.01
45	002152	广电运通	32,939	225,632.15	0.01
46	300747	锐科激光	1,543	216,035.43	0.01
47	300699	光威复材	6,149	201,072.30	0.01
48	601958	金钼股份	29,800	199,660.00	0.01
49	300454	深信服	1,604	140,414.16	0.00
50	601869	长飞光纤	3,345	125,437.50	0.00
51	300770	新媒股份	1,271	109,941.50	0.00
52	300676	华大基因	1,847	105,352.88	0.00

53	002920	德赛西威	4,569	102,345.60	0.00
54	601019	山东出版	12,630	98,261.40	0.00
55	601949	中国出版	14,559	94,633.50	0.00
56	300759	康龙化成	2,728	93,243.04	0.00
57	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
58	603379	三美股份	2,052	76,621.68	0.00
59	300762	上海瀚讯	1,233	71,514.00	0.00
60	603590	康辰药业	1,828	71,090.92	0.00
61	300133	华策影视	10,000	67,300.00	0.00
62	002955	鸿合科技	1,108	65,194.72	0.00
63	300773	拉卡拉	1,250	64,725.00	0.00
64	300771	智莱科技	1,126	62,887.10	0.00
65	300672	国科微	2,003	62,713.93	0.00
66	002901	大博医疗	1,834	60,301.92	0.00
67	603387	基蛋生物	2,332	59,815.80	0.00
68	300737	科顺股份	6,133	57,650.20	0.00
69	603587	地素时尚	2,442	55,531.08	0.00
70	002933	新兴装备	1,262	54,518.40	0.00
71	002902	铭普光磁	1,905	50,863.50	0.00
72	300568	星源材质	2,096	48,312.80	0.00
73	300766	每日互动	1,193	48,304.57	0.00
74	002918	蒙娜丽莎	3,856	45,153.76	0.00
75	300634	彩讯股份	2,058	44,596.86	0.00
76	600157	永泰能源	26,523	44,558.64	0.00
77	603359	东珠生态	2,611	44,256.45	0.00
78	603121	华培动力	2,385	43,216.20	0.00
79	300664	鹏鹞环保	3,640	42,915.60	0.00
80	300709	精研科技	865	41,814.10	0.00
81	603466	风语筑	2,494	41,275.70	0.00
82	300678	中科信息	1,860	40,938.60	0.00
83	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
84	300740	御家汇	4,758	38,587.38	0.00
85	603365	水星家纺	2,111	38,187.99	0.00
86	600933	爱柯迪	4,860	38,151.00	0.00
87	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
88	603416	信捷电气	1,506	36,957.24	0.00
89	300726	宏达电子	1,548	36,532.80	0.00
90	603083	剑桥科技	1,140	35,431.20	0.00
91	603283	赛腾股份	1,349	35,303.33	0.00

92	300719	安达维尔	2,847	34,733.40	0.00
93	300745	欣锐科技	1,304	34,386.48	0.00
94	300708	聚灿光电	2,742	34,137.90	0.00
95	300691	联合光电	2,069	34,014.36	0.00
96	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
97	603214	爱婴室	919	33,699.73	0.00
98	002923	润都股份	1,716	33,101.64	0.00
99	601086	国芳集团	5,799	32,416.41	0.00
100	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
101	603680	今创集团	2,020	31,754.40	0.00
102	603301	振德医疗	1,493	31,054.40	0.00
103	002906	华阳集团	2,742	30,957.18	0.00
104	002891	中宠股份	1,719	30,770.10	0.00
105	002888	惠威科技	1,291	30,015.75	0.00
106	603516	淳中科技	1,173	29,712.09	0.00
107	603538	美诺华	1,346	28,844.78	0.00
108	300588	熙菱信息	2,208	27,622.08	0.00
109	603773	沃格光电	881	27,557.68	0.00
110	300671	富满电子	1,319	27,461.58	0.00
111	603533	掌阅科技	1,691	27,208.19	0.00
112	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
113	603063	禾望电气	2,361	26,159.88	0.00
114	300698	万马科技	1,350	26,136.00	0.00
115	603499	翔港科技	1,137	25,900.86	0.00
116	300730	科创信息	1,395	25,668.00	0.00
117	603912	佳力图	1,717	25,445.94	0.00
118	603890	春秋电子	2,208	24,773.76	0.00
119	300622	博士眼镜	1,790	24,702.00	0.00
120	603855	华荣股份	2,728	23,951.84	0.00
121	300692	中环环保	1,615	23,142.95	0.00
122	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
123	603129	春风动力	1,075	22,392.25	0.00
124	603080	新疆火炬	1,187	22,386.82	0.00
125	002835	同为股份	2,252	21,506.60	0.00
126	603607	京华激光	1,028	20,950.64	0.00
127	603848	好太太	1,377	20,117.97	0.00
128	603321	梅轮电梯	2,725	19,919.75	0.00
129	002903	宇环数控	1,392	19,599.36	0.00
130	002919	名臣健康	1,231	19,425.18	0.00

131	002899	英派斯	1,408	19,247.36	0.00
132	002922	伊戈尔	1,245	18,899.10	0.00
133	603110	东方材料	1,186	18,442.30	0.00
134	603289	泰瑞机器	2,075	18,363.75	0.00
135	300626	华瑞股份	2,174	18,283.34	0.00
136	603196	日播时尚	2,083	18,205.42	0.00
137	603161	科华控股	1,239	18,064.62	0.00
138	603500	祥和实业	1,406	17,687.48	0.00
139	300669	沪宁股份	841	17,560.08	0.00
140	300693	盛弘股份	1,294	17,443.12	0.00
141	603721	中广天择	1,035	17,129.25	0.00
142	603041	美思德	1,034	17,019.64	0.00
143	603331	百达精工	999	16,573.41	0.00
144	603183	建研院	1,374	15,251.40	0.00
145	603477	振静股份	1,955	14,975.30	0.00
146	603655	朗博科技	881	14,122.43	0.00
147	603813	原尚股份	741	13,552.89	0.00
148	603269	海鸥股份	795	11,964.75	0.00
149	603277	银都股份	10	97.00	0.00

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	77,475,345.74	3.83
2	601318	中国平安	48,762,212.84	2.41
3	601166	兴业银行	47,441,722.00	2.34
4	601336	新华保险	37,703,966.80	1.86
5	601838	成都银行	35,751,000.00	1.77
6	002773	康弘药业	32,651,700.00	1.61
7	000100	TCL 集团	32,197,200.00	1.59
8	600036	招商银行	31,910,574.00	1.58
9	600741	华域汽车	28,202,037.00	1.39
10	601988	中国银行	27,206,175.00	1.34
11	601328	交通银行	24,531,130.00	1.21
12	601009	南京银行	22,182,772.00	1.10

13	002555	三七互娱	21,560,000.00	1.06
14	001979	招商蛇口	20,435,728.13	1.01
15	601997	贵阳银行	18,713,133.00	0.92
16	600519	贵州茅台	18,649,975.13	0.92
17	600000	浦发银行	17,287,375.70	0.85
18	601200	上海环境	16,970,000.00	0.84
19	600690	海尔智家	16,638,074.00	0.82
20	000895	双汇发展	16,573,200.00	0.82

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	601988	中国银行	22,822,709.00	1.13
2	601166	兴业银行	18,989,238.99	0.94
3	600352	浙江龙盛	16,468,205.45	0.81
4	601601	中国太保	12,338,400.00	0.61
5	601318	中国平安	11,339,340.00	0.56
6	000895	双汇发展	9,961,120.00	0.49
7	600016	民生银行	9,393,812.00	0.46
8	600036	招商银行	9,337,900.00	0.46
9	601336	新华保险	8,519,340.00	0.42
10	600309	万华化学	7,260,000.00	0.36
11	000800	一汽轿车	6,397,300.00	0.32
12	000333	美的集团	5,967,570.00	0.29
13	600015	华夏银行	5,685,055.00	0.28
14	600741	华域汽车	5,135,760.00	0.25
15	000792	*ST 盐湖	4,907,334.00	0.24
16	601628	中国人寿	3,884,300.00	0.19
17	601607	上海医药	3,639,355.84	0.18
18	601939	建设银行	3,019,400.00	0.15
19	000418	小天鹅 A	2,779,164.00	0.14
20	000876	新希望	2,540,255.96	0.13

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	1,034,272,578.26
卖出股票收入 (成交) 总额	263,332,054.75

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	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

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	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

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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	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

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	12,449,650.20	0.36
2	110046	圆通转债	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	蒙电转债	2,235,000.00	0.07
7	132013	17 宝武 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	250,102.69	0.01
14	132012	17 巨化 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	123003	蓝思转债	2,903.10	0.00
19	128036	金农转债	1,355.70	0.00
20	110038	济川转债	1,058.60	0.00
21	113505	杭电转债	1,047.50	0.00

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	601200	上海环境	19,110,000.00	0.56	大宗交易购入流通受限

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

份额级别	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
兴全沪深 300 指数 (LOF)A	527,508	3,215.58	514,737,405.28	30.35%	1,181,505,719.85	69.65%
兴全沪深 300 指数 C	957	57,632.43	53,054,082.56	96.19%	2,100,151.46	3.81%
合计	528,465	3,314.12	567,791,487.84	32.42%	1,183,605,871.31	67.58%

8.2 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	高德荣	1,285,089.00	3.43%
2	钟贵洋	1,186,928.00	3.17%
3	欧阳兰	853,101.00	2.28%
4	易超	636,200.00	1.70%
5	何雅丽	621,411.00	1.66%
6	崔自强	484,000.00	1.29%
7	周素菊	416,623.00	1.11%
8	胡庆南	398,800.00	1.06%
9	南通市通建房地产有限公司	381,854.00	1.02%
10	李鹏	374,598.00	1.00%

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	份额级别	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	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	3,915,572.38	0.2308%
	兴全沪深 300 指数 C	-	-
	合计	3,915,572.38	0.2236%

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	份额级别	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	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	>100
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	0
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	0

§ 9 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
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	1,325,805,454.82	-
本报告期期间基金总申购份额	1,293,220,431.07	55,254,833.24
减:本报告期期间基金总赎回份额	922,782,760.76	100,599.22
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	1,696,243,125.13	55,154,234.02

注：1、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。

2、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。

§ 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, 詹鸿飞先生担任公司副总经理暨首席信息官, 严长胜先生担任公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

2019 年 1 月, 中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月, 中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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	1,182,613,403.25	100.00%	866,840.75	100.00%	-

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	68,487,184.90	100.00%	4,202,487,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	旗下各基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	关于调整部分旗下基金在国元证券费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 1 月 14 日
3	关于长期停牌股票（长春高新）估值方法调整的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
4	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定投费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 3 月 29 日
5	关于长期停牌股票（格力电器）估值方法调整的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 3 日
6	关于调整部分旗下基金在爱建证券费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 8 日
7	关于增聘副总经理的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 12 日
8	关于长期停牌股票（隆基股份）估值方法调整的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 4 月 13 日
9	关于增加兴证期货公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 21 日
10	关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 22 日
11	关于调整旗下部分基金参加中国银行定投费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 27 日
12	关于旗下基金所持证券（中科曙光）调整估值价的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 27 日
13	关于调整网上直销基金转换、赎回转购优惠费率的公告	证券时报、基金管理人网站	2019 年 6 月 27 日

§ 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 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。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴全基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日