## 兴全全球视野股票型证券投资基金 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: 兴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。

基金托管人兴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	兴全全球视野股票
场内简称	_
基金主代码	340006
前端交易代码	_
后端交易代码	_
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月20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	1, 272, 859, 163. 94 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	_
上市日期	_

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以全球视野的角度,主要投资于富有成长性、
	竞争力以及价值被低估的公司,追求当期收益实现与
	长期资本增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投
	资策略。以全球视野的角度挖掘中国证券市场投资的
	历史机遇,采取"自上而下"的方法,定性与定量研
	究相结合,在股票与债券等资产类别之间进行资产配
	置。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+15%×中证国债指数+5%×同业
	存款利率
风险收益特征	较高风险、较高收益

## 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	
	姓名	冯晓莲	张志永	
信息披露负责人	联系电话	021-20398888	021-62677777	
电子邮箱		fengxl@xqfunds.com	zhangzhy@cib.com.cn	
客户服务电话		4006780099, 021-	95561	
		38824536		
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(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	16, 249, 946. 36
本期利润	-144, 170, 910. 04

加权平均基金份额本期利润	-0.0922
本期基金份额净值增长率	-5.88%
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. 5776
期末基金资产净值	2, 008, 011, 700. 11
期末基金份额净值	1. 5776

- 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. 91%	1. 14%	4. 09%	0. 54%	-1.18%	0.60%
过去三个月	-2.89%	0. 93%	4.74%	0.50%	-7.63%	0. 43%
过去六个月	-5.88%	0.81%	8.34%	0. 46%	-14. 22%	0.35%
过去一年	-5. 32%	0. 78%	12.80%	0. 54%	-18. 12%	0. 24%
过去三年	47. 09%	1.82%	55.84%	1. 38%	-8.75%	0. 44%
自成立以来	494. 30%	1. 53%	156. 11%	1. 47%	338. 19%	0.06%

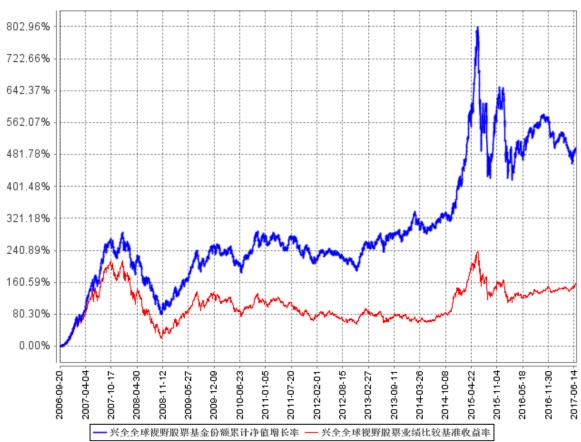
注:本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股,对沪深市场的覆盖度高,具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债市场(包括银行间、上交所、深交所)的综合性指数,也是债券品种中比较基准的参考。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

Return t =80%×(沪深 300 指数 t / 沪深 300 指数 t-1 -1)+15%×(中证国债指数 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



兴全全球视野股票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《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为 2006 年 9 月 20 日至 2007 年 3 月 19 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合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、兴全无添益货币市场基金、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

44 KZ	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从	2유 미디	
姓名	职务	任职日期	离任日期	业年限	说明
吴圣涛	基理资监基兴业优合金(基理管投总本、商式混基(LOF)经	2015年12月31日	_	15 年	经济学硕士,历任汉唐证 券研究员,国泰人寿保险 有限责任公司投资经理, 华富基金管理有限公司基 金经理,东吴基金管理有 限公司基金经理,兴全基 金管理有限公司兴全有机 增长灵活配置混合型证券 投资基金基金经理。

注: 1、职务指截止报告期末的职务(报告期末仍在任的)或离任前的职务(报告期内离任的)。

- 2、任职日期指基金合同生效之日(基金成立时即担任基金经理)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、《兴全全球 视野股票型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,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、考察是否存在非公平的因素。

#### 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

今年上半年,A股总体呈现上涨走势,指数在一季度上涨后,二季度出现一定回落但随后继续上涨。其中,上证指数、上证 50 指数维持相对强势,创业板指数、中证 500 指数表现相对偏弱。白马龙头公司得到极大的聚焦,低估值业绩持续增长、强者恒强特征被市场进一步强化。内生增长一般、高估值类成长类股票持续表现较弱,显示市场风险偏好的变化以及主题并购模式的衰退。上半年来看,本基金坚持以优质个股为主要的配置标准,仓位相对稳定,同时适当把握对新标的个股的挖掘。

#### 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-5.88%,业绩比较基准收益率为8.34%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为市场对国内经济受地产影响的预期过于悲观,经济增长的持续性可能会有较大的韧性。全球来看,美联储加息进程和缩表预期,将带来全球央行的连锁反应。然而随着金融去杠杆、市场监管趋严等因素影响,市场估值体系会持续分化。

在此基础上,我们认为市场会越来越重视公司的内生增长能力,重视财务报表的质量,现金流和 ROE 比外延式带来的利润增长更加重要。对既有个股持仓,我们持续反复审视比较,更加重视报表质量,保留商业模式优秀、管理层较佳,同时以内生增长为主的公司。关注行业格局演进下,龙头公司对细分子行业的溢价。从长期业绩增长的角度,而非基于择时、市场风格转换的视角来选择个股。对以外延式为主,需要再融资推动增长,且现金流偏差的高估值类公司,选择异常严格。

本基金判断 2017 年下半年,市场可能会维持一个区间震荡走势,上市公司业绩增长可能会 提供收益和抵御风险的手段,因此本基金将坚持自身的投资理念,重点挖掘医疗服务、保险等受 益于人口老龄化的行业,精选具有良好商业模式,管理层战略眼光、执行能力俱佳的个股。

本基金将坚持均衡配置、集中持有和严格的风险控制,积极为投资者创造长期投资回报。

## 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有3年以上相关工作经历,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》、《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》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

#### § 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《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》与《兴全全球视野股票型证券投资基金托管协议》,自 2006 年 9 月 20 日起托管兴业全球视野(即更名后的"兴全全球视野")股票型证券投资基金(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: 兴全全球视野股票型证券投资基金

报告截止日: 2017年6月30日

单位: 人民币元

資产      附注号      本期末 2017 年 6 月 30 日      上年度末 2016 年 12 月 31 日        資产:      (銀行存款      67,734,078.40      28,685,782.84        结算备付金      1,725,794.80      1,434,659.47        存出保证金      840,836.54      598,210.33        交易性金融资产      1,958,063,347.18      2,953,245,439.42        其中: 股票投资      1,871,086,981.08      2,809,157,840.42        基金投资      -      -        债券投资      86,976,366.10      144,087,599.00        资产支持证券投资      -      -        贵金属投资      -      -        労生金融资产      -      -        炭上金融资产      -      -        炭上金融资产      -      -        変し性多融资产      -      -        変し性多融资产      -      -        変し性の放利      -      -        変し性財産      -      -        変しを財産      -      -        変しを財産      -      -        変しを財産      -      -        変しを      -      -        変しを      -      -        変し      - <th></th> <th>I</th> <th></th> <th>平世: 人民中九</th>		I		平世: 人民中九
数产:  2017年6月30日  2016年12月31日    银行存款  67,734,078.40  28,685,782.84    结算备付金  1,725,794.80  1,434,659.47    存出保证金  840,836.54  598,210.33    交易性金融资产  1,958,063,347.18  2,953,245,439.42    其中: 股票投资  1,871,086,981.08  2,809,157,840.42    基金投资   -    债券投资  86,976,366.10  144,087,599.00    资产支持证券投资   -    大多属投资   -    行生金融资产  - 40,940,163.56    应收证券清算款  7,702,452.27  714,059.49    应收利息  1,733,601.17  2,206,819.99    应收利息  1,733,601.17  2,206,819.99    应收申购款  575,948.85  612,331.68    递延所得税资产   -    真他资产  - 2,038,376,059.21  3,028,437,466.78    女债:  2017年6月30日  2016年12月31日    女债:   -    短期借款   -    交易性金融负债   -    交易性金融负债   -    交易性金融负债   -    交易性金融负债   -    交易性金融负债   -    交易性金融负债   -    支別 </th <th>资 产</th> <th>  附注号</th> <th>本期末</th> <th>上年度末</th>	资 产	附注号	本期末	上年度末
银行存款 67,734,078.40 28,685,782.84 结算备付金 1,725,794.80 1,434,659.47 存出保证金 840,836.54 598,210.33 交易性金融资产 1,958,063,347.18 2,953,245,439.42 其中:股票投资 1,871,086,981.08 2,809,157,840.42 基金投资 65,45% 66,307.89 9,151,450.15 应付赎回款 696,307.89 9,151,450.15	ж /	Litter 2	2017年6月30日	2016年12月31日
### ### ### ### #####################	资 产:			
存出保证金    840,836.54    598,210.33      交易性金融资产    1,958,063,347.18    2,953,245,439.42      其中: 股票投资    1,871,086,981.08    2,809,157,840.42      基金投资    -    -      债券投资    86,976,366.10    144,087,599.00      资产支持证券投资    -    -      贵金属投资    -    -      作生金融资产    -    -      英入返售金融资产    -    40,940,163.56      应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收股利    -    -      应收时剩款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      本期末 2017年6月30日    上年度末 2016年12月31日      负债:    短期借款    -    -      短期借款    -    -    -      交易性金融负债    -    -    -      短期付款    -    -    -      交易性金融负债    -    -    -      互供方式    -    -    -	银行存款		67, 734, 078. 40	28, 685, 782. 84
交易性金融资产    1,958,063,347.18    2,953,245,439.42      其中:股票投资    1,871,086,981.08    2,809,157,840.42      基金投资    -    -      债券投资    86,976,366.10    144,087,599.00      资产支持证券投资    -    -      贵金属投资    -    -      所生金融资产    -    -      买入返售金融资产    -    40,940,163.56      应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收申购款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      大生度末    2017年6月30日    2016年12月31日      负债:    -    -      短期借款    -    -      交易性金融负债    -    -      按比金融负债    -    -      交易性金融负债    -    -      应付证券清算款    696,307.89    9,151,450.15      应付证券清算款    25,691,504.76    1,851,573.68	结算备付金		1, 725, 794. 80	1, 434, 659. 47
其中: 股票投资    1,871,086,981.08    2,809,157,840.42      基金投资    -    -      债券投资    86,976,366.10    144,087,599.00      资产支持证券投资    -    -      贵金属投资    -    -      医全融资产    -    40,940,163.56      应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收股利    -    -      应收时剩款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      大度费油的有者权益 <b>M注号 本期末</b>	存出保证金		840, 836. 54	598, 210. 33
基金投资  -  -    债券投资  86, 976, 366. 10  144, 087, 599. 00    资产支持证券投资  -  -    贵金属投资  -  -    买入返售金融资产  -  40, 940, 163. 56    应收证券清算款  7, 702, 452. 27  714, 059. 49    应收利息  1, 733, 601. 17  2, 206, 819. 99    应收股利  -  -    应收申购款  575, 948. 85  612, 331. 68    递延所得税资产  -  -    其他资产  -  -    交产总计  2, 038, 376, 059. 21  3, 028, 437, 466. 78    本期末  上年度末    2017年6月30日  2016年12月31日    负债:  -  -    短期借款  -  -    交易性金融负债  -  -    专出回购金融资产款  -  -    应付证券清算款  696, 307. 89  9, 151, 450. 15    应付赎回款  25, 691, 504. 76  1, 851, 573. 68	交易性金融资产		1, 958, 063, 347. 18	2, 953, 245, 439. 42
债券投资  86,976,366.10  144,087,599.00    资产支持证券投资  -  -    贵金属投资  -  -    死と金融资产  -  40,940,163.56    应收证券清算款  7,702,452.27  714,059.49    应收利息  1,733,601.17  2,206,819.99    应收申购款  -  -    应收申购款  575,948.85  612,331.68    递延所得税资产  -  -    其他资产  -  -    方旁总计  2,038,376,059.21  3,028,437,466.78    大事財未 2017年6月30日  上年度末 2016年12月31日    负债:  -  -    短期借款  -  -    交易性金融负债  -  -    劳生金融负债  -  -    劳生金融负债  -  -    专出回购金融资产款  -  -    应付证券清算款  696,307.89  9,151,450.15    应付赎回款  25,691,504.76  1,851,573.68	其中: 股票投资		1, 871, 086, 981. 08	2, 809, 157, 840. 42
资产支持证券投资    -    -      贵金属投资    -    -      死入返售金融资产    -    40,940,163.56      应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收申购款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      大期未    上年度末      2017 年 6 月 30 日    2016 年 12 月 31 日      负债:    -    -      短期借款    -    -      交易性金融负债    -    -      衍生金融负债    -    -      交易性金融负债    -    -      查出回购金融资产款    -    -      应付证券清算款    696,307.89    9,151,450.15      应付赎券清算款    25,691,504.76    1,851,573.68	基金投资		_	_
费金属投资    —    —      衍生金融资产    —    40,940,163.56      应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收申购款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    —    —      其他资产    —    —      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      大度产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      上年度末 2017年6月30日    2016年12月31日      负债:    —    —      短期借款    —    —      交易性金融负债    —    —      衍生金融负债    —    —      资出回购金融资产款    —    —      应付证券清算款    696,307.89    9,151,450.15      应付赎款    25,691,504.76    1,851,573.68	债券投资		86, 976, 366. 10	144, 087, 599. 00
衍生金融资产    -    40,940,163.56      应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收股利    -    -      应收申购款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      负债和所有者权益    附注号    本期末 2017年6月30日    上年度末 2016年12月31日      负债:    短期借款    -      交易性金融负债    -      交易性金融负债    -      交易性金融负债    -      交易性金融负债    -      空付证券清算款    696,307.89    9,151,450.15      应付赎到款    25,691,504.76    1,851,573.68	资产支持证券投资		_	-
买入返售金融资产—40,940,163.56应收证券清算款7,702,452.27714,059.49应收利息1,733,601.172,206,819.99应收股利——应收申购款575,948.85612,331.68递延所得税资产——其他资产——资产总计2,038,376,059.213,028,437,466.78本期末 2017年6月30日上年度末 2016年12月31日负债:短期借款——短期借款——交易性金融负债——亏发射性金融负债——查出回购金融资产款——应付证券清算款696,307.899,151,450.15应付赎回款25,691,504.761,851,573.68	贵金属投资		_	-
应收证券清算款    7,702,452.27    714,059.49      应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收股利    -    -      应收申购款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      本期末    上年度末      2017年6月30日    2016年12月31日      负债:    -    -      短期借款    -    -      交易性金融负债    -    -      卖出回购金融资产款    -    -      应付证券清算款    696,307.89    9,151,450.15      应付赎回款    25,691,504.76    1,851,573.68	衍生金融资产		_	-
应收利息    1,733,601.17    2,206,819.99      应收股利    —    —      应收申购款    575,948.85    612,331.68      递延所得税资产    —    —      其他资产    —    —      资产总计    2,038,376,059.21    3,028,437,466.78      本期末 2017年6月30日    上年度末 2016年12月31日      负债:    —    —      短期借款    —    —      交易性金融负债    —    —      贫生金融负债    —    —      卖出回购金融资产款    —    —      应付证券清算款    696,307.89    9,151,450.15      应付赎回款    25,691,504.76    1,851,573.68	买入返售金融资产		_	40, 940, 163. 56
应收股利    -    -      应收申购款    575, 948. 85    612, 331. 68      递延所得税资产    -    -      其他资产    -    -      资产总计    2, 038, 376, 059. 21    3, 028, 437, 466. 78      本期末 2017年6月30日    上年度末 2016年12月31日      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    696, 307. 89    9, 151, 450. 15      应付赎回款    25, 691, 504. 76    1, 851, 573. 68	应收证券清算款		7, 702, 452. 27	714, 059. 49
应收申购款  575, 948.85  612, 331.68    递延所得税资产  —  —    其他资产  —  —    资产总计  2, 038, 376, 059.21  3, 028, 437, 466.78    本期末 2017年6月30日  上年度末 2016年12月31日    短期借款  —  —    交易性金融负债  —  —    衍生金融负债  —  —    查出回购金融资产款  —  —    应付证券清算款  696, 307.89  9, 151, 450.15    应付赎回款  25, 691, 504.76  1, 851, 573.68	应收利息		1, 733, 601. 17	2, 206, 819. 99
递延所得税资产其他资产资产总计2,038,376,059.213,028,437,466.78负债和所有者权益附注号本期末 2017年6月30日上年度末 2016年12月31日负债:短期借款短期借款交易性金融负债衍生金融负债劳生金融负债支出回购金融资产款应付赎回款696,307.899,151,450.15应付赎回款25,691,504.761,851,573.68	应收股利		_	-
其他资产资产总计2,038,376,059.213,028,437,466.78负债和所有者权益附注号本期末 2017年6月30日上年度末 2016年12月31日负债:短期借款交易性金融负债资生金融负债卖出回购金融资产款应付证券清算款696,307.899,151,450.15应付赎回款25,691,504.761,851,573.68	应收申购款		575, 948. 85	612, 331. 68
资产总计2,038,376,059.213,028,437,466.78负债和所有者权益附注号本期末 2017年6月30日上年度末 2016年12月31日负债: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696,307.899,151,450.15应付赎回款25,691,504.761,851,573.68	递延所得税资产		_	-
负债和所有者权益附注号本期末 2017 年 6 月 30 日上年度末 2016 年 12 月 31 日负债: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696, 307. 899, 151, 450. 15应付赎回款25, 691, 504. 761, 851, 573. 68	其他资产		_	-
负债:2017年6月30日2016年12月31日负债:短期借款交易性金融负债茨出回购金融资产款应付证券清算款696,307.899,151,450.15应付赎回款25,691,504.761,851,573.68	资产总计		2, 038, 376, 059. 21	3, 028, 437, 466. 78
负债:2017年6月30日2016年12月31日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696, 307. 899, 151, 450. 15应付赎回款25, 691, 504. 761, 851, 573. 68	A 佳和庇女·老叔·米	1474年	本期末	上年度末
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696, 307. 899, 151, 450. 15应付赎回款25, 691, 504. 761, 851, 573. 68	<b>火坝和州有有权益</b>	門往与	2017年6月30日	2016年12月31日
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696, 307. 899, 151, 450. 15应付赎回款25, 691, 504. 761, 851, 573. 68	负 债:			
衍生金融负债    -    -      卖出回购金融资产款    -    -      应付证券清算款    696, 307. 89    9, 151, 450. 15      应付赎回款    25, 691, 504. 76    1, 851, 573. 68	短期借款		_	-
卖出回购金融资产款  -  -    应付证券清算款  696, 307. 89  9, 151, 450. 15    应付赎回款  25, 691, 504. 76  1, 851, 573. 68	交易性金融负债		_	-
应付证券清算款696, 307. 899, 151, 450. 15应付赎回款25, 691, 504. 761, 851, 573. 68	衍生金融负债		_	-
应付赎回款 25,691,504.76 1,851,573.68	卖出回购金融资产款		_	
No. 1.1. Information 1. List militia	应付证券清算款		696, 307. 89	9, 151, 450. 15
应付管理人报酬 2,521,660.46 3,959,244.67	应付赎回款		25, 691, 504. 76	1, 851, 573. 68
	应付管理人报酬		2, 521, 660. 46	3, 959, 244. 67
应付托管费 420, 276. 74 659, 874. 12	应付托管费		420, 276. 74	659, 874. 12
应付销售服务费 – – –	应付销售服务费		_	

应付交易费用	820, 586. 41	845, 082. 94
	020, 000. 41	045, 062. 94
应交税费	_	_
应付利息	-	_
应付利润	_	_
递延所得税负债	_	_
其他负债	214, 022. 84	43, 458. 50
负债合计	30, 364, 359. 10	16, 510, 684. 06
所有者权益:		
实收基金	1, 272, 859, 163. 94	1, 796, 910, 963. 78
未分配利润	735, 152, 536. 17	1, 215, 015, 818. 94
所有者权益合计	2, 008, 011, 700. 11	3, 011, 926, 782. 72
负债和所有者权益总计	2, 038, 376, 059. 21	3, 028, 437, 466. 78

注:报告截止日 2017 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.5776 元,基金份额总额

1,272,859,163.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体: 兴全全球视野股票型证券投资基金 本报告期: 2017年1月1日至2017年6月30日

单位: 人民币元

		本期	上年度可比期间
项 目	附注号	2017年1月1日至	2016年1月1日至
		2017年6月30日	2016年6月30日
一、收入		-117, 468, 067. 87	-439, 196, 872. 46
1.利息收入		2, 218, 151. 06	5, 060, 688. 28
其中:存款利息收入		706, 958. 44	2, 858, 896. 91
债券利息收入		1, 389, 587. 25	1, 910, 240. 95
资产支持证券利息收入		_	_
买入返售金融资产收入		121, 605. 37	291, 550. 42
其他利息收入		_	_
2.投资收益(损失以"-"填列)		40, 046, 388. 91	2, 684, 852. 59
其中: 股票投资收益		30, 806, 196. 80	-10, 029, 598. 67
基金投资收益		_	-
债券投资收益		542, 293. 30	316, 726. 42
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		8, 697, 898. 81	12, 397, 724. 84
3.公允价值变动收益(损失以		-160, 420, 856. 40	-456, 497, 524. 81
"-"号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以"-"号		_	_

填列)			
5.其他收入(损失以"-"号填		688, 248. 56	9, 555, 111. 48
列)			
减:二、费用		26, 702, 842. 17	36, 731, 817. 36
1. 管理人报酬		18, 908, 697. 37	24, 384, 003. 84
2. 托管费		3, 151, 449. 58	4, 064, 000. 64
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	_	_
4. 交易费用		4, 456, 312. 48	8, 049, 369. 36
5. 利息支出		_	33, 557. 38
其中: 卖出回购金融资产支出		_	33, 557. 38
6. 其他费用		186, 382. 74	200, 886. 14
三、利润总额(亏损总额以"-		-144, 170, 910. 04	-475, 928, 689. 82
"号填列)			
减: 所得税费用		_	_
四、净利润(净亏损以"-"号		-144, 170, 910. 04	-475, 928, 689. 82
填列)			

## 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 兴全全球视野股票型证券投资基金 本报告期: 2017年1月1日至 2017年6月30日

单位: 人民币元

	本期 2017年1月1日至2017年6月30日				
项目	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, 796, 910, 963. 78	1, 215, 015, 818. 94	3, 011, 926, 782. 72		
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期净利润)		-144, 170, 910. 04	-144, 170, 910. 04		
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)	-524, 051, 799. 84	-335, 692, 372. 73	-859, 744, 172. 57		
其中: 1.基金申购款	108, 861, 613. 75	66, 933, 007. 26	175, 794, 621. 01		
2. 基金赎回款	-632, 913, 413. 59	-402, 625, 379. 99	-1, 035, 538, 793. 58		
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, 272, 859, 163. 94	735, 152, 536. 17	2, 008, 011, 700. 11	
		上年度可比期间		
	2016 年	1月1日至2016年6月	30 日	
项目		ᆂᄼᄼᆓᄀᄼᄓᄓ	17 A 34 eet wheeter	
	实收基金 	未分配利润	所有者权益合计   	
一、期初所有者权益	1, 703, 129, 825. 77	2, 541, 322, 817. 73	4, 244, 452, 643. 50	
(基金净值)		, , ,		
二、本期经营活动产生	-	-475, 928, 689. 82	-475, 928, 689. 82	
的基金净值变动数(本				
期净利润)				
三、本期基金份额交易	188, 327, 085. 31	1, 721, 659, 756. 13	1, 909, 986, 841. 44	
产生的基金净值变动数				
(净值减少以"-"号填				
列)				
其中: 1.基金申购款	4, 456, 596, 566. 88	4, 309, 471, 841. 28	8, 766, 068, 408. 16	
2. 基金赎回款	-4, 268, 269, 481. 57	-2, 587, 812, 085. 15	-6, 856, 081, 566. 72	
四、本期向基金份额持	_	-2, 526, 864, 480. 80	-2, 526, 864, 480. 80	
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	1, 891, 456, 911. 08	1, 260, 189, 403. 24	3, 151, 646, 314. 32	
(基金净值)				

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:

## 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

兴全全球视野股票型证券投资基金(原名兴业全球视野股票型证券投资基金,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")证监基金字[2006]149 号文《关于同意兴业全球视野股票型证券投资基金募集的批复》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2006年9月20日正式生效,首次设立募集规模为3,289,724,684.59 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴全基金管理有限公司,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日起更名为兴全全球视野股票型证券投资基金。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

本基金为股票型基金,股票投资比例为80%-95%、债券投资比例为0%-20%、权证投资比例为0%-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于5%。

本基金的业绩比较基准为 "80%×沪深 300 指数+15%×中证国债指数+5%×同业存款利率"

#### 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 年上半年度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,自 2008 年 9 月 19 日起,出让方按 0.1%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。
- (7) 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、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 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、注册登记机构、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。

#### 6.4.7 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

			1 1- 7 11 1 7 -		
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		
	成交金额	占当期股票		占当期股票	
		成交总额的比例	成交金额	成交总额的比	
		<b>双</b> 文 思		例	
兴业证券	428, 691, 002. 37	15. 56%	1, 390, 059, 354. 36	24. 36%	

#### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本其	<b>朔</b>	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		
	成交金额	占当期债券		占当期债券	
		成交总额的比例	成交金额	成交总额的比	
		及文心积的记忆		例	
兴业证券	_	_	170, 789. 40	0.33%	

#### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

				1/_ F	W-1-12.	
	关联方名称	本期		上年度可比期间		
		2017年1月1日至20	017年6月30日	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		占当期债券	
			成交总额的比例	回购成交金额	回购	
			以又心积的山門		成交总额的比例	
>	兴业证券	_	-	174, 000, 000. 00	5. 22%	

#### 6.4.7.1.4 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。

### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

	本期						
关联方名称		2017年1月1日至2017年6月30日					
	当期	占当期佣金总量的	期末应付佣金余额	占期末应付佣			
	佣金	比例	<b>州本四刊州玉</b> 赤领	金总额的比例			
兴业证券	316, 372. 88	13. 01%	130, 740. 15	15. 93%			
	上年度可比期间						
<b>学</b> 段士力 <del>拉</del>	2016年1月1日至2016年6月30日						
<b>关联方名称</b>	当期	占当期佣金总量的	期末应付佣金余额	占期末应付佣			
	佣金	比例	<b>州本四刊州玉</b> 赤领	金总额的比例			
兴业证券	1, 019, 618. 54	22. 33%	521, 973. 37	31. 96%			

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

	本期	上年度可比期间
项目	2017年1月1日至2017年	2016年1月1日至2016年6月
	6月30日	30 日
当期发生的基金应支付	18, 908, 697. 37	24, 384, 003. 84
的管理费		
其中: 支付销售机构的	2, 291, 481. 33	2, 176, 588. 75
客户维护费		

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。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

	本期	上年度可比期间
项目	2017年1月1日至2017年	2016年1月1日至2016年6月
	6月30日	30 日
当期发生的基金应支付	3, 151, 449. 58	4, 064, 000. 64
的托管费		

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。

#### 6.4.7.2.3 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。

#### 6.4.7.4 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

份额单位:份

	本期	上年度可比期间
项目	2017年1月1日至2017年	2016年1月1日至2016年6月
	6月30日	30 日
基金合同生效日(	_	_
2006年9月20日)持有		
的基金份额		
期初持有的基金份额	_	4, 479, 437. 32
期间申购/买入总份额	_	1, 391, 850. 01
期间因拆分变动份额	_	_
减:期间赎回/卖出总份额	_	_
期末持有的基金份额	_	5, 871, 287. 33
期末持有的基金份额	_	0. 3104%
占基金总份额比例		

注: 1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额,期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定,符合公允性要求。

#### 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

		本期	上年度可比期间			
关联方	2017年1月1	日至 2017 年 6 月	2016年1月1日至2	2016年6月30日		
名称	3	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	67, 734, 078. 40	681, 311. 94	49, 320, 280. 43	2, 586, 384. 92		

#### 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 1 10	1 1 22	限证券	米豆	股票					金额里位:人	氏叩兀
证券	证券	成功	可流	流通受限类型		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 25日	2017 年 8月 28日	非公开发行流通受限	6. 29	10. 40	7, 949, 126	50, 000, 002. 54	82, 670, 910. 40	-
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	1, 045, 296	59, 999, 990. 40	52, 212, 535. 20	_
600604	市北高新	2016年 8月 31日	2017 年 8月 29日	非公开发行流通受限	15. 31	7. 15	1, 959, 504	30, 000, 006. 24	14, 010, 453. 60	注 1
600604	市北高新	2017年 5月 26日	2017 年 8月 29日	非公开转增	_	7. 15	1, 959, 504	-	14, 010, 453. 60	
603003	龙宇燃油	2016年 9月 28日	2017 年 9月 26日	非公开 发行流 通受限	14. 66	14. 96	682, 128	9, 999, 996. 48	10, 204, 634. 88	_
603117		2016年 9月8日	2017 年 9月 6日	非公开发行流通受限	16. 41	12. 11	609, 385	10, 000, 007. 85	7, 379, 652. 35	_
601137	博威合金	2016年 8月 18日	2017 年 8月 18日	非公开 发行流 通受限	11. 20	11. 33	315, 476	3, 533, 331. 20	3, 574, 343. 08	_
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	注 2
002821	凯莱	2017年	2017	新股转		72. 97	21, 409	_	1, 562, 214. 73	

	英	6月	年	增						
		14 日	11月							
			20 日							
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: 本基金持有的非公开发行股票市北高新,于 2017 年 5 月 26 日实施 2016 年 第 20 页 共32 页

度权益分配方案, 向全体股东每 1 股派 0.02 元(含税); 同时,以资本公积金向全体股东每 1 股转增 1 股。本基金新增 1,959,504 股。

注 2: 本基金持有的新股凯莱英,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 .00 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。

注 3: 上述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。

#### 6.4.8.2 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
300271	华宇软件	2017 年 6月 22日	筹划 重大 事项	16. 59	2017 年 7月 4日	16. 80	12, 338, 811	229, 942, 863. 39	204, 700, 874. 49	_
000403	ST 生 化	2017 年 6月 21日	筹划 重大 事项	30. 93	I		3, 788, 817	118, 380, 223. 75	117, 188, 109. 81	注1
601088	中国神华	2017 年 6月 5日	筹划 重大 事项	22. 29		-	600, 000	8, 878, 622. 09	13, 374, 000. 00	_

注 1: 根据上市公司公告, ST 生化于 2017 年 6 月 21 日下午开市起停牌。

#### 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。

#### 6.4.8.3.2 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。

#### 6.4.9 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	1, 871, 086, 981. 08	91. 79
	其中: 股票	1, 871, 086, 981. 08	91. 79
2	固定收益投资	86, 976, 366. 10	4. 27
	其中:债券	86, 976, 366. 10	4. 27
	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	_	_
	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	69, 459, 873. 20	3. 41
7	其他各项资产	10, 852, 838. 83	0. 53
8	合计	2, 038, 376, 059. 21	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	_	_
В	采矿业	16, 034, 126. 40	0.80
С	制造业	1, 282, 146, 632. 53	63. 85
D	电力、热力、燃气及水生产和供 应业	24, 989, 611. 68	1. 24
Е	建筑业	_	_
F	批发和零售业	13, 761, 255. 76	0. 69
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	_	_
T	信息传输、软件和信息技术服务业	245, 996, 514. 11	12. 25

J	金融业	11, 955, 000. 00	0.60
K	房地产业	43, 440, 907. 20	2. 16
L	租赁和商务服务业	7, 379, 652. 35	0. 37
M	科学研究和技术服务业	197, 701, 000. 00	9.85
N	水利、环境和公共设施管理业	_	_
0	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	27, 682, 281. 05	1. 38
S	综合	_	_
	合计	1, 871, 086, 981. 08	93. 18

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港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	300271	华宇软件	12, 338, 811	204, 700, 874. 49	10. 19
2	600079	人福医药	10, 207, 088	200, 263, 066. 56	9. 97
3	300054	鼎龙股份	19, 651, 942	199, 860, 250. 14	9. 95
4	000919	金陵药业	18, 358, 861	198, 642, 876. 02	9. 89
5	300012	华测检测	42, 700, 000	197, 701, 000. 00	9.85
6	002152	广电运通	23, 450, 000	194, 869, 500. 00	9. 70
7	002007	华兰生物	3, 937, 600	143, 722, 400. 00	7. 16
8	000403	ST 生化	3, 788, 817	117, 188, 109. 81	5. 84
9	000413	东旭光电	7, 949, 126	82, 670, 910. 40	4. 12
10	002594	比亚迪	1, 045, 296	52, 212, 535. 20	2. 60

## 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	002007	华兰生物	277, 601, 368. 34	9. 22
2	300054	鼎龙股份	121, 074, 541. 13	4. 02
3	002027	分众传媒	99, 600, 000. 00	3. 31
4	600079	人福医药	80, 700, 674. 24	2. 68
5	300271	华宇软件	66, 744, 606. 75	2. 22
6	000919	金陵药业	61, 263, 506. 24	2. 03
7	002174	游族网络	37, 440, 000. 00	1. 24
8	300012	华测检测	37, 375, 375. 88	1. 24
9	000403	ST 生化	31, 826, 908. 82	1.06
10	600031	三一重工	29, 477, 709. 86	0. 98
11	000333	美的集团	28, 270, 000. 00	0. 94
12	600309	万华化学	20, 858, 480. 79	0. 69
13	002450	康得新	17, 760, 000. 00	0. 59
14	002152	广电运通	16, 504, 782. 04	0. 55
15	603979	金诚信	13, 435, 500. 00	0. 45
16	300144	宋城演艺	10, 542, 689. 72	0. 35
17	300124	汇川技术	7, 905, 942. 81	0. 26
18	601200	上海环境	7, 905, 039. 30	0. 26
19	600019	宝钢股份	7, 120, 960. 00	0. 24
20	600596	新安股份	6, 213, 387. 28	0. 21

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	600079	人福医药	141, 874, 403. 53	4.71
2	300054	鼎龙股份	141, 682, 468. 38	4. 70
3	002007	华兰生物	141, 594, 513. 30	4.70
4	002027	分众传媒	96, 777, 830. 95	3. 21

5	300083	劲胜智能	72, 398, 522. 86	2. 40
6	601318	中国平安	71, 743, 969. 54	2. 38
7	002152	广电运通	62, 586, 394. 72	2. 08
8	000919	金陵药业	57, 986, 407. 29	1. 93
9	600716	凤凰股份	50, 503, 513. 82	1. 68
10	601009	南京银行	47, 448, 297. 75	1. 58
11	001979	招商蛇口	47, 419, 746. 17	1. 57
12	300271	华宇软件	44, 334, 401. 59	1. 47
13	600809	山西汾酒	41, 664, 041. 01	1. 38
14	600803	新奥股份	39, 357, 028. 98	1. 31
15	300184	力源信息	37, 585, 569. 54	1. 25
16	600105	永鼎股份	33, 562, 055. 58	1. 11
17	300017	网宿科技	32, 196, 717. 29	1. 07
18	600297	广汇汽车	30, 669, 270. 62	1. 02
19	000333	美的集团	29, 017, 952. 56	0. 96
20	601601	中国太保	26, 511, 014. 10	0.88

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	990, 490, 038. 46
卖出股票收入(成交)总额	1, 799, 035, 180. 10

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	74, 661, 882. 00	3. 72
2	央行票据	_	_
3	金融债券	10, 001, 000. 00	0.50
	其中: 政策性金融债	10, 001, 000. 00	0.50
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, 313, 484. 10	0. 12
8	同业存单		_
9	其他	_	_

10	合计	86, 976, 366. 10	4. 33

## 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	019546	16 国债 18	600, 000	59, 934, 000. 00	2. 98
2	019552	16 国债 24	147, 900	14, 727, 882. 00	0. 73
3	150417	15 农发 17	100, 000	10, 001, 000. 00	0. 50
4	132006	16 皖新 EB	13, 500	1, 430, 190. 00	0.07
5	120001	16 以岭 EB	3, 300	365, 706. 00	0.02

# 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

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

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

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	840, 836. 54
2	应收证券清算款	7, 702, 452. 27
3	应收股利	_
4	应收利息	1, 733, 601. 17
5	应收申购款	575, 948. 85
6	其他应收款	_
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	10, 852, 838. 83

#### 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	132006	16 皖新 EB	1, 430, 190. 00	0. 07
2	120001	16 以岭 EB	365, 706. 00	0. 02
3	127003	海印转债	138, 244. 00	0. 01

#### 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	300271	华宇软件	204, 700, 874. 49	10. 19	重大事项停牌	
2	000403	ST 生化	117, 188, 109. 81	5. 84	重大事项停牌	
3	000413	东旭光电	82, 670, 910. 40	4. 12	非公开发行	
4	002594	比亚迪	52, 212, 535. 20	2. 60	非公开发行	

#### 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

		持有人结构					
持有人户数	户均持有的 基金份额	机构投资者		个人投资者			
(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例		
88, 100	14, 447. 89	386, 949, 159. 20	30. 40%	885, 910, 004. 74	69. 60%		

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金不属于上市基金。

## 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	1, 171, 312. 54	0. 0920%	
持有本基金			

## 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		10 <sup>~</sup> 50
部门负责人持有本开放式基金		

本基金基金经理持有本开放式基金	50 <sup>~</sup> 100

## § 9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日 ( 2006 年 9 月 20 日 ) 基金份额总额	3, 289, 724, 684. 59
本报告期期初基金份额总额	1, 796, 910, 963. 78
本报告期基金总申购份额	108, 861, 613. 75
减:本报告期基金总赎回份额	632, 913, 413. 59
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	1, 272, 859, 163. 94

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

## 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

		股票图	<b></b>	应支付该券商的佣金		
券商名称	交易单元 数量	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	备注
中泰证券	2	768, 467, 893. 23	27. 88%	715, 674. 58	29. 43%	_
国信证券	1	589, 952, 968. 55	21. 41%	549, 425. 40	22. 59%	-
兴业证券	2	428, 691, 002. 37	15. 56%	316, 372. 88	13. 01%	-
中信证券	3	417, 737, 585. 96	15. 16%	336, 941. 20	13. 86%	-
西南证券	1	293, 421, 467. 47	10. 65%	273, 263. 91	11. 24%	-
平安证券	1	175, 642, 526. 03	6. 37%	163, 577. 28	6. 73%	-
中投证券	1	82, 029, 098. 09	2. 98%	76, 393. 24	3. 14%	1
湘财证券	1	-	_	_	_	1
东方证券	1	-	_	_	_	-
中金公司	1	_	_	_	_	1
德邦证券	1	-	_	_	_	-
国元证券	1	-	_	_	_	-
高华证券	1	_	-	-	-	-
中银国际	1	_	-	_	-	_
民族证券	1	_	_	_	_	_
国都证券	1	_	_	_	_	_

华鑫证券	1	_	_	_	_	_
华福证券	1	_	_	-	_	_
银河证券	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

	债券	交易	债券回购	京交易	权证	交易
券商名称	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
中泰证券	114, 825, 464. 10	81.44%	411, 000, 000. 00	84. 60%	-	_
国信证券	26, 170, 970. 00	18. 56%	_	_	_	_
兴业证券	-	_	_	-	_	_
中信证券	-	_	_	_	_	_
西南证券	-	_	_	_	_	_
平安证券	_	_	_	-	_	_
中投证券	-	_	74, 800, 000. 00	15. 40%		_
湘财证券	-	_	_	-	_	_
东方证券	_	_	_	_	_	_
中金公司	-	_	_	-	_	_
德邦证券	-	_	_	-	_	_
国元证券	_	_	_	_	_	_
高华证券	-	_	_	-	_	_
中银国际	-	_	_	-	_	_
民族证券	-	_	_	-	_	_
国都证券	-	_	_	-	_	_
华鑫证券	-	-	_	-	-	_
华福证券	-	_	_	-	-	_
银河证券	-	_		_		_

### § 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	_	_	_	_	_	-	_
个人	-	_	-	-	I	_	_

#### 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 2017年8月29日