

兴全保本混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

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。

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.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
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.....	46
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52

§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全保本混合型证券投资基金
基金简称	兴全保本混合
场内简称	-
基金主代码	163411
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	2011 年 8 月 3 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	693,872,384.59 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	本基金通过特定组合保险策略，在确保保本周期到期时的保本底线的基础上，寻求组合资产的稳定增长。
投资策略	<p>1、基于可转债投资的 OBPI 策略，即以可转债所隐含的看涨期权代替投资组合保险策略所要求的看涨期权，利用可转债自身特性来避免因为频繁调整低风险资产与风险资产配比带来的交易成本。</p> <p>2、可转债与股票替代的 TIPP 策略，即采用时间不变性投资组合保险策略实现保本目标。同时，本基金将选择转换溢价率较小的可转债进行投资，但当可转债</p>

	市场无投资合适品种时，本基金将用股票资产部分或全部代替可转债的 TIPP 策略实现组合保险目的。
业绩比较基准	3 年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张志永
	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, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 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	上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址）
邮政编码		200122	200041
法定代表人		兰荣	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司	深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 23 楼 2308 房

§ 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	25,924,694.39
本期利润	16,055,290.82
加权平均基金份额本期利润	0.0218
本期加权平均净值利润率	1.68%
本期基金份额净值增长率	1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	315,671,317.69
期末可供分配基金份额利润	0.4549
期末基金资产净值	913,431,690.02
期末基金份额净值	1.3164
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	52.81%

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	2.03%	0.17%	0.23%	0.01%	1.80%	0.16%
过去三个月	1.25%	0.16%	0.70%	0.01%	0.55%	0.15%
过去六个月	1.74%	0.13%	1.39%	0.01%	0.35%	0.12%
过去一年	6.16%	0.14%	2.83%	0.01%	3.33%	0.13%
过去三年	32.33%	0.47%	10.22%	0.01%	22.11%	0.46%
自成立以来	52.81%	0.37%	25.81%	0.01%	27.00%	0.36%

注：本基金业绩比较基准：3 年期银行定期存款税后收益率。本基金选择三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准的原因如下：本基金是保本型基金，保本周期为三年，保本但不保证收益率。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

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：

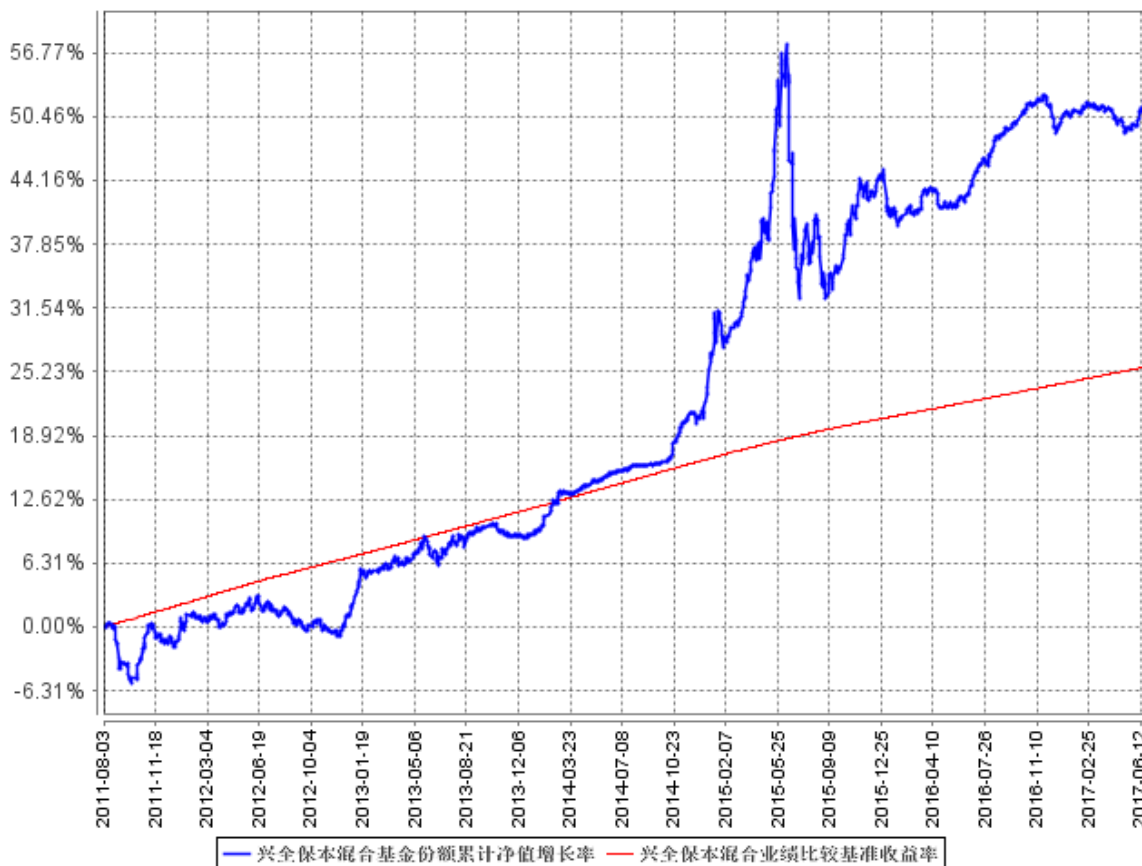
$$\text{Return } t = 3 \text{ 年期银行定期存款税后收益率 } t/360$$

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全保本混合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《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2011 年 8 月 3 日至 2012 年 2 月 2 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理着十八只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张亚辉	本基金、兴全可转债混	2015 年 11 月 2 日	-	12 年	经济学学士。历任兴全基金管理有限公司渠道经理、财务会计、固定收益

	合型证 券投资 基金基 金经理			交易员、专户投资部投资 经理。
--	--------------------------	--	--	--------------------

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

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全保本混合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、考察是否存在不公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济增速略超预期，PPI 高点回落并短期趋于稳定，从中长期看经济长 L 型底没有改变，供给侧改革推进使得经济仍处于结构调整、有效需要一般和去产能的阵痛期，经济下行压力虽然较大但增长仍能持续。外围看，英国脱欧的后续谈判和美国加息预期走低利好国内债市，人民币汇率贬值的不利因素也有所缓解。通胀压力缓解，上半年 CPI 均在低位运行，但商品类价格在供给侧和下游需求的双重作用下仍处于高位，因此代表生产资料价格的 PPI 短期不会大幅下行。货币政策看，仍是稳字当头，政策冲击减少，央行货币政策转变，从 2015 年的传统刺激为主的货币宽松和扩大投放为主的信贷宽松向“稳信用、稳货币”的双稳政策转变。一季度信贷大幅增长，4 月份信贷骤跌，5 月回归平稳，也表明央行的稳健货币思路，对流动性的调控央行也更为精准了，不仅体现在量上同时也体现在预期的管理上，6 月份在市场担心重演 13 年钱荒的背景下，央行及时注入流动性平滑了资金面。

上半年债券市场先抑后扬，5 月初 10 年国债收益率触及 3.7%，刷新了 16 年 10 月份以来的新高，6 月末 10 年国债收益率回落至 3.5% 附近。转债市场也是先经历了 5 月份股债双杀的阵痛，5 月底 6 月初经历了一波反弹。权益市场分化较为明显，白马蓝筹屡创新高而创业板跌幅较大。

本基金报告期内增加了转债的仓位，纯债部分控制久期并把控信用风险，权益部分中性仓位，股票选择上更关注其估值和业绩增长的确定性。

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 1.74%，业绩比较基准收益率为 1.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济仍有一定的韧性，增速大概率还能持续 1-2 个季度，流动性仍维持中性判断，在降杠杆和维稳的合力下央行更多地是做好预期管理，股市仍将维持结构性行情，由于供给侧改革导致的上游资源品的价格上涨将会持续，这将反应在企业利润上，下半年周期型股票可能会有所表现，债券上如果由于短期经济强劲带来的调整将会是中长期布局的机会。

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》、《兴全保本混合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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本托管人依据《兴全保本混合型证券投资基金合同》与《兴全保本混合型证券投资基金托管协议》，自 2011 年 8 月 3 日起托管兴全保本混合型证券投资基金（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合规守信、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。

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：兴全保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	28,210,472.87	32,272,051.76
结算备付金		1,806,973.29	3,521,307.91
存出保证金		209,054.37	352,257.13
交易性金融资产	6.4.7.2	826,056,245.80	938,082,866.53
其中：股票投资		85,756,261.69	71,211,199.50
基金投资		-	-
债券投资		740,299,984.11	866,871,667.03
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	20,000,000.00	3,000,000.00
应收证券清算款		30,035,547.95	5,002,815.28

应收利息	6.4.7.5	11,675,999.15	16,040,051.33
应收股利		-	-
应收申购款		36,556.96	77,028.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		918,030,850.39	998,348,378.34
负债和所有者权益	附注号	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		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,113,848.13	554,798.56
应付管理人报酬		975,857.08	1,140,264.11
应付托管费		150,131.86	175,425.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	229,667.72	274,557.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,655.58	31,635.93
负债合计		4,599,160.37	2,176,681.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	597,760,372.33	663,240,978.07
未分配利润	6.4.7.10	315,671,317.69	332,930,719.08
所有者权益合计		913,431,690.02	996,171,697.15

负债和所有者权益总计		918,030,850.39	998,348,378.34
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3164 元，基金份额总额 693,872,384.59 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		24,116,278.97	-1,459,510.83
1.利息收入		19,442,252.97	33,484,443.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	492,324.90	634,973.49
债券利息收入		18,832,004.66	32,849,470.04
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		117,923.41	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,288,929.24	1,117,907.15
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,902,057.81	-19,730,815.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	10,240,453.37	20,593,641.63
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	146,418.06	255,080.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,869,403.57	-37,537,900.55
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	254,500.33	1,476,039.04

减：二、费用		8,060,988.15	14,757,366.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,171,435.14	7,687,124.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	949,451.56	1,182,634.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	760,913.96	2,104,249.87
5. 利息支出		39,790.99	3,636,278.83
其中：卖出回购金融资产支出		39,790.99	3,636,278.83
6. 其他费用	6.4.7.20	139,396.50	147,078.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,055,290.82	-16,216,877.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,055,290.82	-16,216,877.36

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	663,240,978.07	332,930,719.08	996,171,697.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,055,290.82	16,055,290.82
三、本期基金份额交易	-65,480,605.74	-33,314,692.21	-98,795,297.95

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	8,600,893.38	4,392,400.18	12,993,293.56
2.基金赎回款	-74,081,499.12	-37,707,092.39	-111,788,591.51
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)	597,760,372.33	315,671,317.69	913,431,690.02
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,084,535,777.70	484,631,704.14	1,569,167,481.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-16,216,877.36	-16,216,877.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-346,342,793.77	-144,032,736.41	-490,375,530.18
其中: 1.基金申购款	13,227,351.19	5,475,872.13	18,703,223.32
2.基金赎回款	-359,570,144.96	-149,508,608.54	-509,078,753.50
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)	738,192,983.93	324,382,090.37	1,062,575,074.30

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

兴全保本混合型证券投资基金(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”)证监许可[2011]522 号文《关于核准兴全保本混合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 2011 年 8 月 3 日正式生效,首次设立募集规模为 1,493,369,048.31 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为兴全基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司,基金保证人为深圳市高新投集团有限公司。

根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金对持有人认购并持有到期的基金份额进行保本,未持有到保本周期到期日的份额持有人不适用本条款。在保本周期到期日,如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上认购并持有到期的基金份额累计分控款项之和计算的总金额低于其认购保本金额,则基金管理人应补足该保本差额,并在保本周期到期日后 20 个工作日内将该保本差额支付给基金份额持有人,保证人对此提供不可撤销的连带责任担保。保本期间为三年,自本基金基金合同生效之日起至三年后的对应日止。保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金将转入下一保本周期。如果保本周期到期后,本基金未能符合保本基金存续条件,则本基金将按基金合同的约定,转型为非保本的兴全精选股票型证券投资基金,基金投资、基金费率等相关内容也将根据本合同约定做相应修改。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括投资于股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券等)、货币市场工具、权证及中国证监会允许基金

投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产的 0%-30%;债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 70%-100%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

本基金的业绩比较基准为 3 年期银行定期存款税后收益率。

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 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所

得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。

(2) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税。

(3) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

(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。

6.4.7 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 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	28,210,472.87
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月-1 年	-
其他存款	-
合计：	28,210,472.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	78,751,280.74	85,756,261.69	7,004,980.95	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	296,524,267.27	298,363,984.11	1,839,716.84
	银行间市场	439,038,580.82	441,936,000.00	2,897,419.18
	合计	735,562,848.09	740,299,984.11	4,737,136.02
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	814,314,128.83	826,056,245.80	11,742,116.97	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中；买断式逆回购
买入返售证券	20,000,000.00	-
合计	20,000,000.00	-

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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	30,438.14
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	731.79
应收债券利息	11,668,392.35
应收买入返售证券利息	-23,698.63
应收申购款利息	50.81
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	84.69
合计	11,675,999.15

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
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	225,192.72
银行间市场应付交易费用	4,475.00
合计	229,667.72

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,632.72
预提费用	118,022.86
其他	-
合计	129,655.58

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	769,881,365.09	663,240,978.07
本期申购	9,983,745.16	8,600,893.38
本期赎回(以“-”号填列)	-85,992,725.66	-74,081,499.12
- 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	693,872,384.59	597,760,372.33

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	341,205,096.39	-8,274,377.31	332,930,719.08
本期利润	25,924,694.39	-9,869,403.57	16,055,290.82
本期基金份额交易产生的变动数	-35,348,141.68	2,033,449.47	-33,314,692.21
其中：基金申购款	4,555,090.75	-162,690.57	4,392,400.18
基金赎回款	-39,903,232.43	2,196,140.04	-37,707,092.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	331,781,649.10	-16,110,331.41	315,671,317.69

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	478,495.34
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	11,739.46
其他	2,090.10
合计	492,324.90

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
----	----

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	293,824,004.81
减：卖出股票成本总额	289,921,947.00
买卖股票差价收入	3,902,057.81

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 2017年1月1日至2017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	9,432,152.00
债券投资收益——赎回差价收入	808,301.37
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	10,240,453.37

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 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	765,595,933.06
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	734,546,324.50
减：应收利息总额	21,617,456.56
买卖债券差价收入	9,432,152.00

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	10,910,000.00
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	10,000,000.00
减：赎回债券应收利息总额	101,698.63
赎回差价收入	808,301.37

6.4.7.13.4 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

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	146,418.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	146,418.06

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-9,869,403.57
——股票投资	2,670,219.41
——债券投资	-12,539,622.98
——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	-
合计	-9,869,403.57

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	212,576.23
其他收入	24,000.00
转换费收入	17,924.10
-	-
合计	254,500.33

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	754,363.96
银行间市场交易费用	6,550.00
合计	760,913.96

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	94,219.55
账户维护费用	9,000.00
银行手续费	2,573.64
上清所账户维护费	9,800.00
-	-
合计	139,396.50

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
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。

6.4.10 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		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 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	558,168,032.89	100.00%	1,539,617,603.57	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		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 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	566,365,338.20	100.00%	693,624,940.42	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		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	
	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	985,000,000.00	100.00%	15,515,000,000.00	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 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	408,618.32	100.00%	225,192.72	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	1,128,337.84	100.00%	465,853.91	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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	6,171,435.14
其中：支付销售机构的客户维护费	1,359,357.97	1,535,746.91

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30%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×1.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	949,451.56	1,182,634.58

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 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×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	28,210,472.87	478,495.34	20,028,680.86	512,259.35

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

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017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
002821	凯莱英	2016年11月11日	2017年11月20日	新股流通受限	30.53	72.97	21,409	653,616.77	1,562,214.73	-
002821	凯莱英	2017年6月14日	2017年11月20日	新股流通受限-转增	-	72.97	21,409	-	1,562,214.73	注1

注：1、本基金持有的新发行股票凯莱英，于2017年6月14日实施2016年度权益分配方案，向全体股东每股派0.5元（含税），向全体股东每10股转增10股，本基金新增21,409股。

2、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。

6.4.12.2 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	复牌日期	复牌开盘单	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-----------	--------	--------	----

				价		价				
300100	双林 股份	2017 年 4 月 5 日	重大资 产重组	25.96	-	-	219,600	5,748,080.80	5,700,816.00	-

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 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、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。本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，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。

6.4.13.4 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 2017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	28,210,472.87	-	-	-	-	-	28,210,472.87
结算备付金	1,806,973.29	-	-	-	-	-	1,806,973.29
存出保证金	209,054.37	-	-	-	-	-	209,054.37
交易性金	100,271,74,249,182.3	160,876,000.0	232,427,948.9	72,467,852.90	85,756,261.69		826,056,245.8

融资产	9,000.00	0	0	1			0
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	-	-	20,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	30,035,547.95	30,035,547.95
应收利息	-	-	-	-	-	11,675,999.15	11,675,999.15
应收申购款	-	-	-	-	-	36,556.96	36,556.96
资产总计	150,505,500.53	174,249,182.30	160,876,000.00	232,427,948.91	72,467,852.90	127,504,365.75	918,030,850.39
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,113,848.13	3,113,848.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	975,857.08	975,857.08
应付托管费	-	-	-	-	-	150,131.86	150,131.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	229,667.72	229,667.72
其他负债	-	-	-	-	-	129,655.58	129,655.58
负债总计	-	-	-	-	-	4,599,160.37	4,599,160.37
利率敏感度缺口	150,505,500.53	174,249,182.30	160,876,000.00	232,427,948.91	72,467,852.90	122,905,205.38	913,431,690.02
上年度末 2016 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

月 31 日							
资产							
银行存款	32,272,051.76	-	-	-	-	-	32,272,051.76
结算备付金	3,521,307.91	-	-	-	-	-	3,521,307.91
存出保证金	352,257.13	-	-	-	-	-	352,257.13
交易性金融资产	-	-302,163,422.29	463,205,726.10	101,502,518.64	71,211,199.50	938,082,866.53	
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	-	-	3,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	5,002,815.28	5,002,815.28	
应收利息	-	-	-	-	16,040,051.33	16,040,051.33	
应收申购款	14.91	-	-	-	77,013.49	77,028.40	
资产总计	39,631.71	-302,163,422.29	463,205,726.10	101,502,518.64	92,331,079.60	998,348,378.34	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	554,798.56	554,798.56	
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,140,264.11	1,140,264.11	
应付托管费	-	-	-	-	175,425.25	175,425.25	
应付交易	-	-	-	-	274,557.34	274,557.34	

费用							
其他负债	-	-	-	-	-	31,635.93	31,635.93
负债总计	-	-	-	-	-	2,176,681.19	2,176,681.19
利率敏感度缺口	39,145,631.71	-302,163,422.29	463,205,726.10	101,502,518.64	90,154,398.41	996,171,697.15	

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(2017年6月30日)	上年度末(2016年12月31日)
	利率 +1%	-6,298,966.36	-16,065,386.87
	利率 -1%	6,564,313.87	16,835,783.39

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、权证等权益类资产占基金资产的 0%-30%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 70%-100%，其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府

债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	85,756,261.69	9.39	71,211,199.50	7.15
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	740,299,984.11	81.05	866,871,667.03	87.02
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	826,056,245.80	90.43	938,082,866.53	94.17

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 (2017 年 6 月 30 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准+10%	10,952,454.23	5,752,493.88

	业绩比较基准-10%	-10,952,454.23	-5,752,493.88
--	------------	----------------	---------------

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	85,756,261.69	9.34
	其中：股票	85,756,261.69	9.34
2	固定收益投资	740,299,984.11	80.64
	其中：债券	740,299,984.11	80.64
	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	20,000,000.00	2.18
	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	30,017,446.16	3.27
7	其他各项资产	41,957,158.43	4.57
8	合计	918,030,850.39	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,489,443.69	4.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,899,516.00	0.54
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,947,768.00	0.43
J	金融业	27,937,518.00	3.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,482,016.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	85,756,261.69	9.39

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	562,800	27,920,508.00	3.06
2	000858	五粮液	180,226	10,031,379.16	1.10
3	002027	分众传媒	689,100	9,482,016.00	1.04
4	600690	青岛海尔	601,200	9,048,060.00	0.99
5	300100	双林股份	219,600	5,700,816.00	0.62
6	600068	葛洲坝	435,900	4,899,516.00	0.54
7	000423	东阿阿胶	67,800	4,874,142.00	0.53
8	002174	游族网络	124,300	3,947,768.00	0.43
9	601100	恒立液压	235,223	3,831,782.67	0.42
10	002821	凯莱英	42,818	3,124,429.46	0.34
11	002570	贝因美	211,679	2,878,834.40	0.32
12	601878	浙商证券	1,000	17,010.00	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	601318	中国平安	25,615,903.00	2.57
2	002027	分众传媒	23,814,444.00	2.39
3	601238	广汽集团	15,903,444.30	1.60
4	000858	五粮液	15,566,872.50	1.56

5	600068	葛洲坝	13,841,963.00	1.39
6	002142	宁波银行	9,918,259.20	1.00
7	002831	裕同科技	9,911,909.02	1.00
8	600690	青岛海尔	9,181,945.00	0.92
9	600585	海螺水泥	8,595,621.00	0.86
10	000333	美的集团	8,481,000.00	0.85
11	600028	中国石化	7,963,732.00	0.80
12	603799	华友钴业	7,768,878.00	0.78
13	601186	中国铁建	7,149,162.00	0.72
14	000630	铜陵有色	6,899,108.00	0.69
15	600004	白云机场	6,799,360.12	0.68
16	601336	新华保险	6,217,535.29	0.62
17	603979	金诚信	6,201,000.00	0.62
18	300100	双林股份	5,748,080.80	0.58
19	603589	口子窖	4,854,887.00	0.49
20	002050	三花智控	4,642,263.06	0.47

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	601238	广汽集团	15,921,106.53	1.60
2	002027	分众传媒	14,516,607.83	1.46
3	600068	葛洲坝	13,570,580.94	1.36
4	000630	铜陵有色	11,657,678.77	1.17
5	600486	扬农化工	10,307,890.69	1.03
6	002831	裕同科技	9,666,708.33	0.97

7	000333	美的集团	9,634,612.72	0.97
8	002142	宁波银行	9,285,238.11	0.93
9	300261	雅本化学	8,497,723.70	0.85
10	600585	海螺水泥	8,350,176.58	0.84
11	600028	中国石化	7,987,209.20	0.80
12	603799	华友钴业	7,549,378.00	0.76
13	600309	万华化学	7,294,467.00	0.73
14	002570	贝因美	7,248,228.06	0.73
15	600004	白云机场	6,769,325.12	0.68
16	601186	中国铁建	6,754,031.00	0.68
17	000858	五粮液	6,538,308.26	0.66
18	603979	金诚信	6,221,424.70	0.62
19	601336	新华保险	5,991,475.50	0.60
20	002050	三花智控	5,081,672.00	0.51

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	301,796,789.78
卖出股票收入（成交）总额	293,824,004.81

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	58,528,870.40	6.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,936,000.00	5.47

	其中：政策性金融债	49,936,000.00	5.47
4	企业债券	80,033,759.30	8.76
5	企业短期融资券	260,558,000.00	28.53
6	中期票据	131,442,000.00	14.39
7	可转债（可交换债）	159,801,354.41	17.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	740,299,984.11	81.05

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	041654057	16 船重 CP001	600,000	60,132,000.00	6.58
2	010303	03 国债(3)	593,840	58,528,870.40	6.41
3	1382080	13 三安 MTN2	500,000	50,600,000.00	5.54
4	011764046	17 宁沪高 SCP003	500,000	50,030,000.00	5.48
5	110032	三一转债	300,700	35,723,160.00	3.91

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	209,054.37
2	应收证券清算款	30,035,547.95
3	应收股利	-
4	应收利息	11,675,999.15
5	应收申购款	36,556.96
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,957,158.43

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	110032	三一转债	35,723,160.00	3.91
2	117009	15 九洲债	30,432,000.00	3.33
3	132005	15 国资 EB	17,196,873.00	1.88
4	113008	电气转债	12,856,829.40	1.41
5	132004	15 国盛 EB	9,777,672.80	1.07
6	132006	16 皖新 EB	9,105,543.00	1.00
7	120001	16 以岭 EB	8,442,267.60	0.92
8	123001	蓝标转债	5,240,500.00	0.57
9	127003	海印转债	5,082,500.00	0.56
10	137001	15 美克 EB	3,956,410.00	0.43
11	128012	辉丰转债	3,570,826.16	0.39
12	128010	顺昌转债	2,051,179.35	0.22
13	113010	江南转债	140,913.00	0.02

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	300100	双林股份	5,700,816.00	0.62	重大事项停牌

2	002821	凯莱英	3,124,429.46	0.34	新股流通受限
---	--------	-----	--------------	------	--------

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,735	89,705.54	313,003,397.83	45.11%	380,868,986.76	54.89%

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持有本基金	7,924.08	0.0011%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年8月3日）基金份额总额	1,493,369,048.31
本报告期期初基金份额总额	769,881,365.09
本报告期基金总申购份额	9,983,745.16
减：本报告期基金总赎回份额	85,992,725.66
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	693,872,384.59

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

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

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
兴业证券	2	558,168,032.89	100.00%	408,618.32	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	566,365,338.20	100.00%	985,000,000.00	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 2016 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 1 月 1 日
2	关于长期停牌股票（华宇软件）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 1 月 13 日
3	关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 1 月 17 日
4	关于总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 1 月 21 日
5	关于调整旗下部分基金在招商银行最低申购、追加申购金额及最低赎回、转换转出、持有份额限制的提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 1 月 25 日
6	关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 2 月 8 日
7	关于调整网上直销部分基金转换	中国证券报、上海证	2017 年 2 月 10 日

	优惠费率的公告	券报、基金管理人网站	
8	关于长期停牌股票（长盈精密）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 2 月 15 日
9	关于旗下基金参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 2 月 23 日
10	关于长期停牌股票（网宿科技）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 3 月 3 日
11	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 3 月 9 日
12	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 3 月 13 日
13	关于调整财达证券部分销售业务范围的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 3 月 22 日
14	关于长期停牌股票（通化东宝）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 3 月 24 日
15	关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
16	关于旗下基金参与广发证券网上交易系统委托、手机证券委托软件申购手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 4 月 6 日

17	关于旗下基金参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
18	关于长期停牌股票（华录百纳）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 5 月 12 日
19	关于旗下基金参与中泰证券网上交易系统委托、手机证券委托软件申购手续费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 5 月 26 日
20	关于设立厦门分公司的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 6 月 2 日
21	关于长期停牌股票（欧菲光）估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 6 月 8 日
22	关于网上直销限时开展基金定期转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 6 月 9 日
23	关于调整网上直销部分基金转换优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 6 月 28 日
24	关于 FOF 特定客户资产管理计划通过直销柜台申购基金免除费用的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2017 年 6 月 28 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
机构	1	2017 年 3 月 8 日-2017 年 6 月 30 日	151,065,954.17	0.00	0.00	151,065,954.17	21.77%
	2	2017 年 3 月 16 日-2017 年 6 月 30 日	150,042,979.12	0.00	0.00	150,042,979.12	21.62%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

单一机构的集中大额赎回导致的流动性风险。考虑到单一机构占比大，集中赎回可能影响其他投资者的收益，制定投资策略时，管理人考虑到单一客户占比问题，因此本基金在资产配置上充分考虑流动性，同时关注申赎情况，以便及时调整投资策略。

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、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全保本混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全保本混合型证券投资基金更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件

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

2017 年 8 月 29 日