

兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF） 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.....	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10

4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
§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	14
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	14
§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	16
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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
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	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	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	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54

§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全趋势投资混合（LOF）
场内简称	兴全趋势
基金主代码	163402
前端交易代码	163402
后端交易代码	163403
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2005 年 11 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	7,916,572,097.59 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	2006 年 1 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益，增加投资组合收益的确定性和稳定性；分享中国上市公司高速增长带来的资本增值；减少决策的失误率，实现最优化的风险调整后的投资收益。
投资策略	根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置；运用兴全多维趋势分析系统，对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析，并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面，本基金主要运用“兴全固定收益证券组合优化模型”，在固定

	收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。
业绩比较基准	沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险，中高风险，中高回报的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全基金管理有限公司	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、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	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

§ 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	-10,900,798.22
本期利润	549,012,628.45
加权平均基金份额本期利润	0.0761
本期加权平均净值利润率	7.53%
本期基金份额净值增长率	7.34%
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	3,484,376,233.69
期末可供分配基金份额利润	0.4401
期末基金资产净值	8,355,604,223.02
期末基金份额净值	1.0555
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	1,155.95%

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	5.90%	0.69%	2.82%	0.34%	3.08%	0.35%
过去三个月	3.65%	0.66%	2.64%	0.32%	1.01%	0.34%
过去六个月	7.34%	0.63%	4.61%	0.29%	2.73%	0.34%
过去一年	11.04%	0.57%	7.58%	0.35%	3.46%	0.22%
过去三年	99.38%	1.19%	38.29%	0.87%	61.09%	0.32%
自成立以来	1,155.95%	1.23%	177.90%	0.91%	978.05%	0.32%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%，业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本基金采用沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深 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。基于本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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：

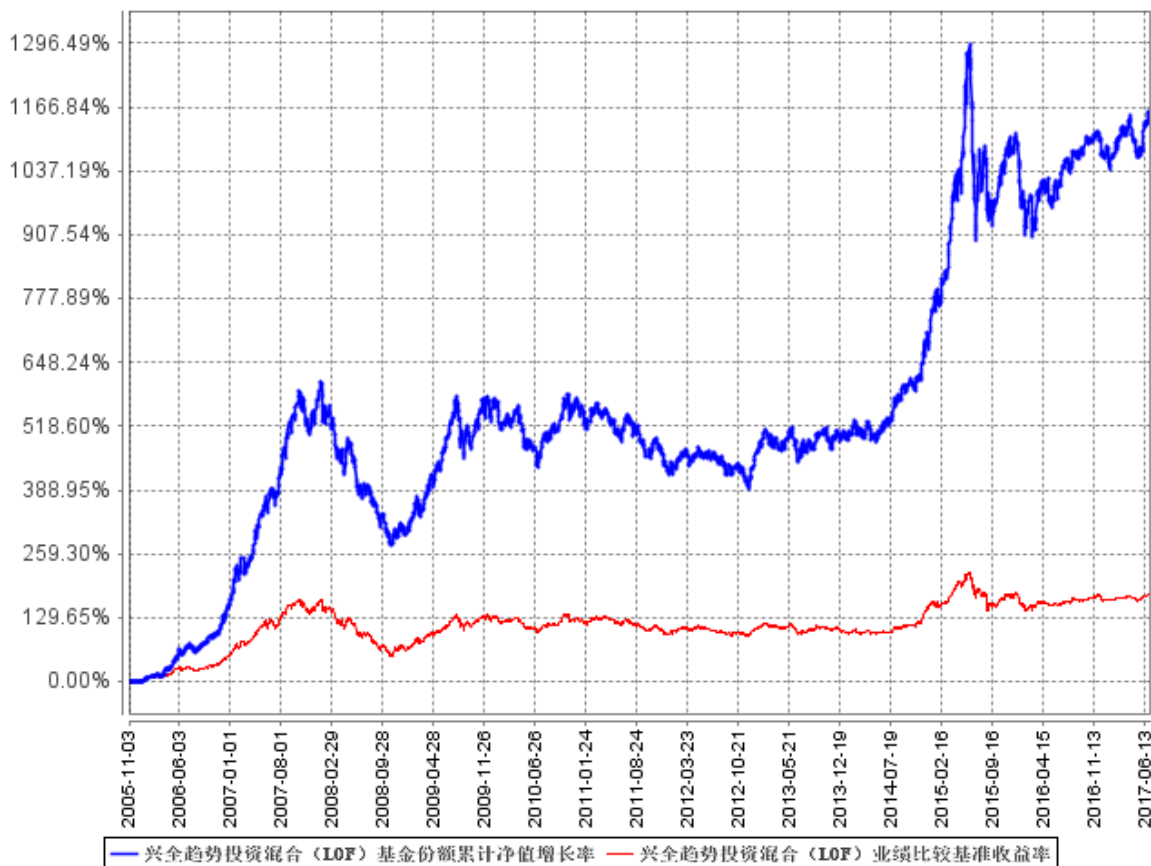
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 45\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{中证国债指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

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

兴全趋势投资混合（LOF）基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2017 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2005 年 11 月 3 日至 2006 年 5 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		
董承非	副总经理、基金管理部投资总监，本基金、	2013 年 10 月 28 日	-	13 年	理学硕士，历任兴全基金管理有限公司研究策划部行业

	兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理				研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、基金管理部副总监、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。
邹欣	研究部总监助理、本基金基金经理、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2015年12月31日	-	9年	金融学硕士，历任富国基金管理有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，兴全基金管理有限公司研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理。

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、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年整个市场延续了去年以来的低波动度的特点，整个市场指数波澜不惊，沪深 300 指数上半年涨幅 10.78%，创业板指数依然表现低迷，跌幅为 7.34%。市场结构性的机会体现在一些低估值的中大型市值的蓝筹股上面。

本基金核心的持仓在一些中型市值的成长股以及一些中游的周期股上面，期间表现一般。上半年本基金把握了金融股的一些机会。

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 7.34%，业绩比较基准收益率为 4.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年上半年中国的经济表现较好，GDP 的增速在 6.9% 的较高速的增长。需求不错，同时叠加供给方面的改革，导致上市公司业绩表现非常好。尤其是一些前几年表现特别惨的行业，比如钢铁，煤炭等周期性行业，今年的业绩表现大超预期。总体而言，今年价值股和周期股表现较好，成长股还在消化历史估值的过程中。

本基金还是会坚持原来的投资风格，为持有人争取好的回报。

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估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有 3 年以上相关工作经验，具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，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《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》与《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》，自 2005 年 11 月 3 日起托管兴业趋势投资（即更名后的“兴全趋势投资”）混合型证券投资基金（LOF）（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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴全趋势混合型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

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

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：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,584,505,666.83	1,107,791,156.33
结算备付金		18,655,115.48	6,197,051.27
存出保证金		3,340,665.46	3,398,433.34
交易性金融资产	6.4.7.2	6,688,353,336.74	5,840,178,908.56
其中：股票投资		6,325,077,326.64	5,477,890,764.36
基金投资		-	-
债券投资		363,276,010.10	362,288,144.20
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	100,000,000.00	-
应收证券清算款		31,763,397.29	-
应收利息	6.4.7.5	4,571,384.87	7,193,197.94
应收股利		-	-
应收申购款		81,312,442.58	5,814,851.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,512,502,009.25	6,970,573,598.69
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		102,029,275.06	-
应付赎回款		37,904,144.19	29,480,917.03
应付管理人报酬		9,838,233.04	11,162,293.77
应付托管费		1,639,705.53	1,860,382.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,162,648.53	3,823,407.87
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	323,779.88	398,235.30
负债合计		156,897,786.23	46,725,236.28
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,982,175,494.24	1,763,061,231.39
未分配利润	6.4.7.10	6,373,428,728.78	5,160,787,131.02
所有者权益合计		8,355,604,223.02	6,923,848,362.41
负债和所有者权益总计		8,512,502,009.25	6,970,573,598.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0555 元，基金份额总额 7,916,572,097.59 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017年1月1日至 2017年6月30日	2016年1月1日至 2016年6月30日
一、收入		629,327,168.97	-264,013,072.40
1.利息收入		13,132,625.40	25,895,053.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,780,197.02	18,438,313.88
债券利息收入		5,034,212.77	5,782,561.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		318,215.61	1,674,178.58
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		54,895,672.75	311,052,726.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	27,303,533.31	273,813,520.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	364,760.61	307,255.43
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	27,227,378.83	36,931,950.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	559,913,426.67	-601,269,738.00
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	1,385,444.15	308,885.32
减：二、费用		80,314,540.52	70,412,531.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	54,028,242.58	48,134,499.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,004,707.06	8,022,416.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	17,082,073.62	14,047,146.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	6.4.7.20	199,517.26	208,469.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		549,012,628.45	-334,425,603.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		549,012,628.45	-334,425,603.75

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,763,061,231.39	5,160,787,131.02	6,923,848,362.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	549,012,628.45	549,012,628.45
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）	219,114,262.85	663,628,969.31	882,743,232.16
其中：1.基金申购款	564,809,881.85	1,727,929,073.56	2,292,738,955.41
2.基金赎回款	-345,695,619.00	-1,064,300,104.25	-1,409,995,723.25
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）	1,982,175,494.24	6,373,428,728.78	8,355,604,223.02
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）	1,071,028,101.37	5,807,727,342.02	6,878,755,443.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-334,425,603.75	-334,425,603.75
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）	32,904,432.43	154,396,606.40	187,301,038.83
其中：1.基金申购款	114,700,906.86	554,028,866.63	668,729,773.49
2.基金赎回款	-81,796,474.43	-399,632,260.23	-481,428,734.66
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）	1,103,932,533.80	5,627,698,344.67	6,731,630,878.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

兰荣
基金管理人负责人

庄园芳
主管会计工作负责人

詹鸿飞
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)(原名“兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)”) (以下简称“本基金”), 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)募集的批复》(证监许可[2005]156号文)的核准, 由兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》发售, 基金合同于2005年11月3日生效。本基金为契约型上市开放式, 存续期限不定, 首次设立募集规模为927,645,098.72份基金份额。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。本基金于2011年1月1日起更名为“兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》和《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)》的有关规定, 本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市交易的股票和固定收益证券(包括各种债券和货币市场工具)及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。在正常市场情况下, 本基金投资组合的比例范围为: 股票资产30%-95%; 固定收益类证券为0%-65%; 现金或者到期日在一年内的政府债券不低于5%。本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数 \times 50%+中证国债指数 \times 45%+同业存款利率 \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求, 同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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 [2015] 101 号《财政部 国家税务总局 证监会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 [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》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《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 [2008] 1 号文《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》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《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] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

券收入免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(g) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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	1,584,505,666.83
定期存款	—
其中：存款期限 1-3 个月	—
其他存款	—

合计：	1,584,505,666.83
-----	------------------

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	5,810,398,473.95	6,325,077,326.64	514,678,852.69	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	368,432,291.44	363,276,010.10	-5,156,281.34
	银行间市场	-	-	-
	合计	368,432,291.44	363,276,010.10	-5,156,281.34
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,178,830,765.39	6,688,353,336.74	509,522,571.35	

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-交易所市场	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

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	603,219.19
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	7,555.32
应收债券利息	3,781,041.31
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	178,216.08
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,352.97
合计	4,571,384.87

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	5,162,648.53
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,162,648.53

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	135,340.78
预提费用	188,439.10
其他	-
合计	323,779.88

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	7,041,440,081.01	1,763,061,231.39
本期申购	2,255,788,099.42	564,809,881.85
本期赎回(以“-”号填列)	-1,380,656,082.84	-345,695,619.00
- 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	7,916,572,097.59	1,982,175,494.24

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	3,097,339,665.90	2,063,447,465.12	5,160,787,131.02
本期利润	-10,900,798.22	559,913,426.67	549,012,628.45

本期基金份额交易产生的变动数	397,937,366.01	265,691,603.30	663,628,969.31
其中：基金申购款	1,010,932,161.81	716,996,911.75	1,727,929,073.56
基金赎回款	-612,994,795.80	-451,305,308.45	-1,064,300,104.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,484,376,233.69	2,889,052,495.09	6,373,428,728.78

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	7,605,145.80
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	98,090.19
其他	76,961.03
合计	7,780,197.02

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	6,403,665,752.43
减：卖出股票成本总额	6,376,362,219.12
买卖股票差价收入	27,303,533.31

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	364,760.61
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	364,760.61

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	12,442,823.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	12,077,000.00
减：应收利息总额	1,062.79
买卖债券差价收入	364,760.61

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

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	27,227,378.83
基金投资产生的股利收益	-
合计	27,227,378.83

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	559,913,426.67
——股票投资	563,676,701.53
——债券投资	-3,763,274.86
——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	559,913,426.67

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	1,375,033.16
转换费收入	10,410.99

其他收入	-
合计	1,385,444.15

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	17,081,978.57
银行间市场交易费用	95.05
合计	17,082,073.62

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	34,630.98
信息披露费	143,808.12
账户维护费用	18,800.00
银行手续费	2,278.16
上市年费	-
其他费用	-
合计	199,517.26

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

本基金以 2017 年 8 月 28 日权益登记日对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 2.647 元进行分红，实际分配收益为人民币 4,775,308,989.13 元。

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	6,626,830,042.02	50.75%	3,115,340,899.61	28.74%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
兴业证券	15,248,308.67	99.43%	-	-

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
兴业证券	450,000,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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	4,870,001.75	50.98%	3,348,645.24	64.86%
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	2,294,017.67	27.14%	1,883,670.65	36.75%

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	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管理费	54,028,242.58	48,134,499.27
其中：支付销售机构的客户维护费	8,334,134.29	8,466,890.88

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。

6.4.10.2.2 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	9,004,707.06	8,022,416.47

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。

6.4.10.2.3 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。

6.4.10.4 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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2005 年 11 月 3 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	6,969,401.27
期间申购/买入总份额	-	13,737,463.94
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	0.00
期末持有的基金份额	-	20,706,865.21
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.4696%

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。

6.4.10.4.2 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	1,584,505,666.83	7,605,145.80	738,676,445.21	18,343,726.27

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于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（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
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	6,968,641	399,999,993.40	348,083,617.95	-
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	31,796,502	199,999,997.58	330,683,620.80	-
600575	皖江物流	2016年7月4日	2017年7月3日	非公开发行流通受限	3.58	4.20	17,205,600	61,596,048.00	72,263,520.00	-
603117	万林股份	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	2,010,968	32,999,984.88	24,352,822.48	-
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	757,150	8,480,080.00	8,578,509.50	-
002821	凯莱	2016年	2017年	新股流通	30.53	72.97	21,409	653,616.77	1,562,214.73	-

	英	11月11日	11月20日	受限						
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
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	2017年	2017年	新股流通	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

	电子	6 月 27 日	7 月 5 日	受限						
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、本基金持有的网下发行新股股票凯莱英，于 2017 年 6 月 14 日实施 2016 年度权益分派方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 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。

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
002696	百洋股份	2017 年 6 月 22 日	筹划重大事项	20.87	2017 年 7 月 3 日	21.74	1,004,942	20,270,106.53	20,973,139.54	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	筹划重大事项	6.21	-	-	1,250,100	9,868,117.00	7,763,121.00	-
300440	运达科技	2017 年 2 月 20 日	筹划重大事项	13.12	-	-	577,200	9,776,168.32	7,572,864.00	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	筹划重大事项	20.00	2017 年 7 月 3 日	18.01	290,000	7,633,710.00	5,800,000.00	-
002504	*ST 弘高	2017 年 5 月 2 日	筹划重大事项	8.10	-	-	573,394	4,896,023.23	4,644,491.40	-
002748	世龙	2017 年	筹划重大	19.45	2017 年 7	20.00	114,000	2,245,696.92	2,217,300.00	-

	实业	6 月 29 日	事项		月 5 日					
300108	双龙股份	2017 年 5 月 12 日	筹划重大事项	7.75	2017 年 8 月 4 日	8.35	268,000	2,467,115.00	2,077,000.00	-

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	-	-

注：本基金于本年度末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	17,779,507.80	15,703,962.40
AAA 以下	50,626,502.30	48,804,181.80
未评级	-	-
合计	68,406,010.10	64,508,144.20

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

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	1,584,505,666.83	-	-	-	-	-	1,584,505,666.83
结算备付金	18,655,115.48	-	-	-	-	-	18,655,115.48
存出保证金	3,340,665.46	-	-	-	-	-	3,340,665.46
交易性金融 资产	-	-	-	361,161,420.30	2,114,589.80	6,325,077,326.64	6,688,353,336.74
买入返售金 融资产	100,000,000.00	-	-	-	-	-	100,000,000.00
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	31,763,397.29	31,763,397.29
应收利息	-	-	-	-	-	4,571,384.87	4,571,384.87
应收申购款	50,017,811.87	-	-	-	-	31,294,630.71	81,312,442.58
资产总计	1,756,519,259.64	-	-	361,161,420.30	2,114,589.80	6,392,706,739.51	8,512,502,009.25
负债							
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	102,029,275.06	102,029,275.06
应付赎回款	-	-	-	-	-	37,904,144.19	37,904,144.19
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	9,838,233.04	9,838,233.04
应付托管费	-	-	-	-	-	1,639,705.53	1,639,705.53

应付交易费用	-	-	-	-	-	5,162,648.53	5,162,648.53
其他负债	-	-	-	-	-	323,779.88	323,779.88
负债总计	-	-	-	-	-	156,897,786.23	156,897,786.23
利率敏感度缺口	1,756,519,259.64	-	-361,161,420.30	2,114,589.80	6,235,808,953.28	8,355,604,223.02	
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
资产							
银行存款	1,107,791,156.33	-	-	-	-	-	1,107,791,156.33
结算备付金	6,197,051.27	-	-	-	-	-	6,197,051.27
存出保证金	3,398,433.34	-	-	-	-	-	3,398,433.34
交易性金融资产	-	-	-362,288,144.20	-	-5,477,890,764.36	-	6,840,178,908.56
应收利息	-	-	-	-	-	7,193,197.94	7,193,197.94
应收申购款	78,529.89	-	-	-	-	5,736,321.36	5,814,851.25
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,117,465,170.83	-	-362,288,144.20	-	-5,490,820,283.66	6,970,573,598.69	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,480,917.03	29,480,917.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	11,162,293.77	11,162,293.77
应付托管费	-	-	-	-	-	1,860,382.31	1,860,382.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,823,407.87	3,823,407.87
其他负债	-	-	-	-	-	398,235.30	398,235.30
负债总计	-	-	-	-	-	46,725,236.28	46,725,236.28
利率敏感度	1,117,465,170.83	-	-362,288,144.20	-	-5,444,095,047.38	6,923,848,362.41	

缺口							
----	--	--	--	--	--	--	--

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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%	-5,505,059.24	-7,093,945.75
	利率-1%	5,653,321.93	7,320,111.22

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

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

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	6,325,077,326.64	75.70	5,477,890,764.36	79.12
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	363,276,010.10	4.35	362,288,144.20	5.23
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	6,688,353,336.74	80.05	5,840,178,908.56	84.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
	本基金持有的股票的涨跌幅与业绩比较基准中的股票指数的涨跌幅一致		
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%	-987,613,233.70	-793,896,473.73
	业绩比较基准+10%	987,613,233.70	793,896,473.73

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	6,325,077,326.64	74.30
	其中：股票	6,325,077,326.64	74.30
2	固定收益投资	363,276,010.10	4.27
	其中：债券	363,276,010.10	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	100,000,000.00	1.17
	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	1,603,160,782.31	18.83
7	其他各项资产	120,987,890.20	1.42
8	合计	8,512,502,009.25	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	20,973,139.54	0.25
B	采矿业	211,852,973.00	2.54
C	制造业	2,859,298,864.43	34.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	87,902,163.94	1.05

E	建筑业	32,564,075.50	0.39
F	批发和零售业	208,688,654.39	2.50
G	交通运输、仓储和邮政业	118,207,319.26	1.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	609,451,881.36	7.29
J	金融业	1,268,620,016.81	15.18
K	房地产业	68,164,921.32	0.82
L	租赁和商务服务业	544,653,102.29	6.52
M	科学研究和技术服务业	31,368,041.55	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	22,538,424.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,290,143.86	0.08
R	文化、体育和娱乐业	234,503,605.39	2.81
S	综合	-	-
	合计	6,325,077,326.64	75.70

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	601601	中国太保	17,790,064	602,549,467.68	7.21
2	601318	中国平安	11,804,405	585,616,532.05	7.01
3	002174	游族网络	11,973,312	380,272,389.12	4.55
4	002594	比亚迪	6,968,641	348,083,617.95	4.17

5	000413	东旭光电	31,796,502	330,683,620.80	3.96
6	002027	分众传媒	23,523,594	323,684,653.44	3.87
7	600584	长电科技	19,559,751	313,934,003.55	3.76
8	300144	宋城演艺	11,236,397	234,503,605.39	2.81
9	000425	徐工机械	61,425,107	230,344,151.25	2.76
10	601100	恒立液压	12,595,463	205,180,092.27	2.46
11	002707	众信旅游	14,733,149	193,446,246.37	2.32
12	601899	紫金矿业	53,803,100	184,544,633.00	2.21
13	600196	复星医药	5,953,376	184,495,122.24	2.21
14	600060	海信电器	11,708,730	177,621,434.10	2.13
15	601933	永辉超市	15,372,968	108,840,613.44	1.30
16	600575	皖江物流	17,205,600	72,263,520.00	0.86
17	300054	鼎龙股份	6,726,261	68,406,074.37	0.82
18	601636	旗滨集团	14,999,963	67,649,833.13	0.81
19	002624	完美世界	1,967,088	67,471,118.40	0.81
20	603338	浙江鼎力	926,605	61,091,067.65	0.73
21	600882	广泽股份	6,087,221	57,037,260.77	0.68
22	300113	顺网科技	2,108,680	56,723,492.00	0.68
23	601689	拓普集团	1,592,334	53,327,265.66	0.64
24	000690	宝新能源	8,718,800	52,138,424.00	0.62
25	002425	凯撒文化	5,558,083	50,800,878.62	0.61
26	002517	恺英网络	1,256,260	44,207,789.40	0.53
27	300261	雅本化学	4,721,227	43,812,986.56	0.52
28	002555	三七互娱	1,383,484	35,375,685.88	0.42
29	600745	闻泰科技	1,847,122	34,559,652.62	0.41
30	000651	格力电器	824,800	33,957,016.00	0.41
31	002422	科伦药业	2,046,018	33,800,217.36	0.40
32	601628	中国人寿	1,148,001	30,973,066.98	0.37

33	600031	三一重工	3,605,590	29,313,446.70	0.35
34	000858	五粮液	514,929	28,660,948.14	0.34
35	300184	力源信息	2,247,541	27,959,410.04	0.33
36	601607	上海医药	957,077	27,640,383.76	0.33
37	600029	南方航空	3,092,089	26,901,174.30	0.32
38	600867	通化东宝	1,458,685	26,606,414.40	0.32
39	603117	万林股份	2,010,968	24,352,822.48	0.29
40	000069	华侨城A	2,240,400	22,538,424.00	0.27
41	601288	农业银行	6,395,100	22,510,752.00	0.27
42	600309	万华化学	780,000	22,339,200.00	0.27
43	001979	招商蛇口	1,010,281	21,579,602.16	0.26
44	002696	百洋股份	1,004,942	20,973,139.54	0.25
45	603993	洛阳钼业	3,639,000	18,413,340.00	0.22
46	002456	欧菲光	944,810	17,167,197.70	0.21
47	002475	立讯精密	539,868	15,785,740.32	0.19
48	300012	华测检测	3,399,882	15,741,453.66	0.19
49	600716	凤凰股份	3,062,144	15,739,420.16	0.19
50	603018	中设集团	482,451	15,626,587.89	0.19
51	600486	扬农化工	365,957	15,447,044.97	0.18
52	600079	人福医药	760,000	14,911,200.00	0.18
53	600519	贵州茅台	31,476	14,851,950.60	0.18
54	002029	七匹狼	1,368,200	13,093,674.00	0.16
55	600703	三安光电	656,660	12,936,202.00	0.15
56	000063	中兴通讯	544,860	12,934,976.40	0.15
57	000423	东阿阿胶	179,300	12,889,877.00	0.15
58	600038	中直股份	272,911	12,491,136.47	0.15
59	002570	贝因美	894,688	12,167,756.80	0.15
60	600335	国机汽车	1,000,000	11,960,000.00	0.14

61	603868	飞科电器	187,337	11,584,920.08	0.14
62	603799	华友钴业	189,600	11,523,888.00	0.14
63	300308	中际装备	268,600	11,047,518.00	0.13
64	600674	川投能源	1,116,300	10,962,066.00	0.13
65	002415	海康威视	330,000	10,659,000.00	0.13
66	600622	嘉宝集团	650,000	10,582,000.00	0.13
67	600886	国投电力	1,320,000	10,428,000.00	0.12
68	002008	大族激光	300,000	10,392,000.00	0.12
69	002024	苏宁云商	900,000	10,125,000.00	0.12
70	600581	八一钢铁	1,002,900	10,099,203.00	0.12
71	002223	鱼跃医疗	418,050	9,899,424.00	0.12
72	000498	山东路桥	1,348,974	9,645,164.10	0.12
73	601988	中国银行	2,606,700	9,644,790.00	0.12
74	300232	洲明科技	602,395	9,638,320.00	0.12
75	600528	中铁工业	664,479	9,495,404.91	0.11
76	300159	新研股份	690,000	9,135,600.00	0.11
77	603589	口子窖	235,000	9,115,650.00	0.11
78	002508	老板电器	208,000	9,043,840.00	0.11
79	600028	中国石化	1,500,000	8,895,000.00	0.11
80	300197	铁汉生态	665,000	8,831,200.00	0.11
81	601137	博威合金	757,150	8,578,509.50	0.10
82	600325	华发股份	1,008,000	8,416,800.00	0.10
83	000828	东莞控股	699,980	8,399,760.00	0.10
84	603000	人民网	626,982	8,257,352.94	0.10
85	600297	广汇汽车	1,036,880	7,807,706.40	0.09
86	601989	中国重工	1,250,100	7,763,121.00	0.09
87	600195	中牧股份	399,926	7,754,565.14	0.09
88	300440	运达科技	577,200	7,572,864.00	0.09

89	000661	长春高新	56,936	7,351,006.96	0.09
90	600048	保利地产	727,200	7,250,184.00	0.09
91	000963	华东医药	139,856	6,950,843.20	0.08
92	600016	民生银行	819,905	6,739,619.10	0.08
93	300244	迪安诊断	199,941	6,290,143.86	0.08
94	600104	上汽集团	200,000	6,210,000.00	0.07
95	600900	长江电力	399,950	6,151,231.00	0.07
96	002355	兴民智通	600,000	6,138,000.00	0.07
97	600089	特变电工	578,134	5,972,124.22	0.07
98	600808	马钢股份	1,670,000	5,911,800.00	0.07
99	600323	瀚蓝环境	399,994	5,803,912.94	0.07
100	300367	东方网力	290,000	5,800,000.00	0.07
101	000400	许继电气	300,000	5,388,000.00	0.06
102	002081	金螳螂	489,000	5,369,220.00	0.06
103	002831	裕同科技	70,000	5,250,000.00	0.06
104	603128	华贸物流	601,868	5,151,990.08	0.06
105	002518	科士达	350,922	5,130,479.64	0.06
106	000157	中联重科	1,137,117	5,105,655.33	0.06
107	600612	老凤祥	99,989	4,896,461.33	0.06
108	601678	滨化股份	700,000	4,865,000.00	0.06
109	002094	青岛金王	219,924	4,690,978.92	0.06
110	600197	伊力特	240,000	4,687,200.00	0.06
111	002504	*ST 弘高	573,394	4,644,491.40	0.06
112	002335	科华恒盛	129,980	4,606,491.20	0.06
113	300231	银信科技	330,000	4,356,000.00	0.05
114	002142	宁波银行	220,000	4,246,000.00	0.05
115	601677	明泰铝业	300,000	4,092,000.00	0.05
116	002713	东易日盛	200,000	4,074,000.00	0.05

117	000783	长江证券	420,900	3,985,923.00	0.05
118	300078	思创医惠	363,060	3,895,633.80	0.05
119	603306	华懋科技	120,000	3,796,800.00	0.05
120	002158	汉钟精机	210,740	3,770,138.60	0.05
121	002668	奥马电器	189,940	3,741,818.00	0.04
122	300061	康旗股份	199,914	3,682,415.88	0.04
123	002311	海大集团	195,740	3,576,169.80	0.04
124	002097	山河智能	399,550	3,551,999.50	0.04
125	000796	凯撒旅游	261,500	3,169,380.00	0.04
126	002821	凯莱英	42,818	3,124,429.46	0.04
127	603899	晨光文具	174,600	3,038,040.00	0.04
128	601021	春秋航空	89,976	3,025,892.88	0.04
129	603708	家家悦	182,299	2,998,818.55	0.04
130	000729	燕京啤酒	445,900	2,996,448.00	0.04
131	000997	新大陆	125,000	2,836,250.00	0.03
132	601006	大秦铁路	293,800	2,464,982.00	0.03
133	600011	华能国际	329,500	2,418,530.00	0.03
134	300170	汉得信息	230,000	2,371,300.00	0.03
135	000036	华联控股	260,000	2,366,000.00	0.03
136	600030	中信证券	138,300	2,353,866.00	0.03
137	600887	伊利股份	107,700	2,325,243.00	0.03
138	603808	歌力思	78,000	2,302,560.00	0.03
139	603101	汇嘉时代	136,900	2,272,540.00	0.03
140	600117	西宁特钢	449,100	2,263,464.00	0.03
141	600383	金地集团	194,500	2,230,915.00	0.03
142	603599	广信股份	146,800	2,221,084.00	0.03
143	002748	世龙实业	114,000	2,217,300.00	0.03
144	600690	青岛海尔	147,300	2,216,865.00	0.03

145	002763	汇洁股份	76,876	2,210,185.00	0.03
146	600066	宇通客车	100,400	2,205,788.00	0.03
147	600276	恒瑞医药	43,600	2,205,724.00	0.03
148	300375	鹏翎股份	110,000	2,174,700.00	0.03
149	603519	立霸股份	100,000	2,166,000.00	0.03
150	600981	汇鸿集团	287,900	2,133,339.00	0.03
151	300108	双龙股份	268,000	2,077,000.00	0.02
152	603609	禾丰牧业	215,587	2,061,011.72	0.02
153	300410	正业科技	50,004	1,805,144.40	0.02
154	600521	华海药业	81,981	1,724,880.24	0.02
155	600213	亚星客车	158,600	1,714,466.00	0.02
156	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.01
157	002859	洁美科技	6,666	486,618.00	0.01
158	002860	星帅尔	7,980	390,222.00	0.00
159	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
160	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
161	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
162	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
163	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
164	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
165	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
166	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
167	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
168	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
169	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
170	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
171	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
172	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00

173	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
174	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
175	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
176	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
177	002615	哈尔斯	5	56.50	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	002027	分众传媒	1,162,905,510.73	16.80
2	601601	中国太保	502,785,771.76	7.26
3	601318	中国平安	457,535,758.30	6.61
4	002174	游族网络	444,535,068.99	6.42
5	000333	美的集团	229,969,494.00	3.32
6	002707	众信旅游	217,134,616.63	3.14
7	601899	紫金矿业	184,973,356.45	2.67
8	300017	网宿科技	171,708,234.71	2.48
9	000001	平安银行	161,164,200.50	2.33
10	600048	保利地产	140,881,491.38	2.03
11	300144	宋城演艺	123,242,263.85	1.78
12	600060	海信电器	103,380,455.15	1.49
13	601933	永辉超市	96,417,829.36	1.39
14	002024	苏宁云商	75,217,689.69	1.09
15	002624	完美世界	74,486,201.24	1.08
16	601636	旗滨集团	66,791,130.57	0.96
17	002739	万达电影	66,461,214.30	0.96

18	600745	闻泰科技	62,323,304.52	0.90
19	300113	顺网科技	59,889,980.64	0.86
20	600029	南方航空	58,309,585.62	0.84

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	002027	分众传媒	886,781,835.47	12.81
2	600048	保利地产	359,435,647.89	5.19
3	000333	美的集团	240,675,505.49	3.48
4	000157	中联重科	228,086,492.82	3.29
5	600398	海澜之家	218,594,804.23	3.16
6	300083	劲胜智能	188,701,621.88	2.73
7	600297	广汇汽车	185,325,843.59	2.68
8	300017	网宿科技	176,596,789.78	2.55
9	002174	游族网络	166,180,553.61	2.40
10	000001	平安银行	160,212,414.88	2.31
11	601600	中国铝业	152,567,189.29	2.20
12	601997	贵阳银行	130,123,286.97	1.88
13	600325	华发股份	106,128,334.03	1.53
14	600773	西藏城投	105,782,901.52	1.53
15	601801	皖新传媒	94,770,974.85	1.37
16	600340	华夏幸福	87,817,980.14	1.27
17	600060	海信电器	81,919,711.95	1.18
18	002024	苏宁云商	73,039,460.69	1.05
19	002739	万达电影	71,541,455.19	1.03

20	600584	长电科技	56,271,820.28	0.81
----	--------	------	---------------	------

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	6,659,872,079.87
卖出股票收入（成交）总额	6,403,665,752.43

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	294,870,000.00	3.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	48,511,912.50	0.58
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	19,894,097.60	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	363,276,010.10	4.35

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	019537	16 国债 09	3,000,000	294,870,000.00	3.53
2	112030	11 鲁西债	479,130	48,511,912.50	0.58
3	132004	15 国盛 EB	158,690	14,856,557.80	0.18
4	132005	15 国资 EB	26,500	2,922,950.00	0.03
5	128015	久其转债	18,580	2,114,589.80	0.03

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	3,340,665.46
2	应收证券清算款	31,763,397.29
3	应收股利	-
4	应收利息	4,571,384.87
5	应收申购款	81,312,442.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,987,890.20

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	132004	15 国盛 EB	14,856,557.80	0.18
2	132005	15 国资 EB	2,922,950.00	0.04

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	002594	比亚迪	348,083,617.95	4.17	非公开发行
2	000413	东旭光电	330,683,620.80	3.96	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
465,311	17,013.51	2,540,542,750.46	32.09%	5,376,029,347.13	67.91%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	上海涌利金融信息服务有限 公司—永韵骐邦一号基金	2,000,068.00	1.22%
2	上海涌利金融信息服务有限 公司—骐邦涌利稳健成长基 金	1,369,873.00	0.83%
3	曾岚	1,330,906.00	0.81%
4	沈燕华	1,234,917.00	0.75%
5	王建鹏	1,098,268.00	0.67%
6	黄建鹏	1,064,100.00	0.65%
7	徐慧均	1,000,000.00	0.61%
8	陈振宇	988,100.00	0.60%
9	蔡锡立	943,956.00	0.58%
10	叶芬	871,676.00	0.53%

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,378,795.06	0.0679%

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

注：本基金的基金经理也是本公司高级管理人员及基金投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年11月3日）基金份额总额	927,645,098.72
本报告期期初基金份额总额	7,041,440,081.01
本报告期基金总申购份额	2,255,788,099.42
减：本报告期基金总赎回份额	1,380,656,082.84
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	7,916,572,097.59

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——毕马威华振会计师事务所（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	36	626,830,042.02	50.75%	4,870,001.75	50.98%	-
中信证券	32	494,760,036.57	19.10%	1,735,353.62	18.16%	-
天风证券	1	928,569,545.80	7.11%	586,203.64	6.14%	-
海通证券	2	831,818,290.53	6.37%	608,310.13	6.37%	-
方正证券	2	655,915,533.68	5.02%	414,076.56	4.33%	-
中信建投	3	382,194,819.85	2.93%	279,499.40	2.93%	-
中金公司	1	299,013,318.03	2.29%	278,466.31	2.91%	-
国金证券	1	256,508,574.75	1.96%	238,887.80	2.50%	-
申万宏源	1	246,765,108.50	1.89%	229,810.23	2.41%	-
民生证券	2	140,718,379.96	1.08%	131,049.16	1.37%	-
东北证券	2	107,384,649.04	0.82%	100,007.60	1.05%	-
光大证券	1	87,817,980.14	0.67%	81,784.86	0.86%	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	15,248,308.67	99.43%	450,000,000.00	100.00%	-	-
中信证券	87,655.50	0.57%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	兴全基金管理有限公司旗下各基金 2016 年 12 月 31 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、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、证券时报、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、证券时报、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、证券时报、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股份有限公司最低申购、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、证券时报、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、证券时报、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优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 2 月 10 日
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、证券时报、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	中国证券报、上海证券报、证券时报、基	2017 年 2 月 23 日

	资手续费率优惠的公告	金管理人网站	
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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 3 日
11	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 13 日
12	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 22 日
13	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 24 日
14	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 28 日
15	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费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 4 月 6 日
16	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 4 月 22 日
17	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 5 月 12 日
18	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费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站	2017 年 5 月 26 日
19	关于设立厦门分公司的公告	中国证券报、上海证	2017 年 6 月 2 日

		券报、证券时报、基金管理人网站	
20	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 8 日
21	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 9 日
22	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 6 月 28 日
23	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、证券时报、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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）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