兴全轻资产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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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遵规守信情况的说明 11

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11

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 11

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 12

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 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13

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 13

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 14

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14

6.1 资产负债表 14

6.2 利润表 16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17

6.4 报表附注 19

§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 47

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49

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 50

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 50

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 50

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 50

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 50

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50

7.12 投资组合报告附注.....51

§8 基金份额持有人信息.....52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....52

8.2 期末上市基金前十名持有人.....52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....53

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.....53

§9 开放式基金份额变动.....53

§10 重大事件揭示.....54

10.1 基金份额持有人大会决议.....54

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.....54

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....54

10.4 基金投资策略的改变.....54

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....54

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.....54

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....55

10.8 其他重大事件.....57

§11 影响投资者决策的其他重要信息.....60

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.....60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....60

§12 备查文件目录.....61

12.1 备查文件目录.....61

12.2 存放地点.....61

12.3 查阅方式.....61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全轻资产混合（LOF）
场内简称	兴全轻资
基金主代码	163412
前端交易代码	163412
后端交易代码	163413
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2012 年 4 月 5 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,914,611,549.62 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	2012 年 5 月 31 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以挖掘“轻资产公司”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。
投资策略	在大类资产配置上，本基金采取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；本基金运用多重指标因子，综合评估判断，选择优秀的轻资产公司进行投资；在行业配置上，除积极配置于那些在产品、服务以及业务属性上具有轻资产特征的行业。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数＋20%×中证国债指数

风险收益特征	本基金为混合型基金产品，属于较高风险、较高收益的基金品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯晓莲	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	fengxl@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099，021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200122	518040
法定代表人		兰荣	李建红

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	-160,666,582.49
本期利润	175,015,393.10
加权平均基金份额本期利润	0.0846
本期加权平均净值利润率	3.34%
本期基金份额净值增长率	3.56%
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	2,126,788,774.58
期末可供分配基金份额利润	1.1108
期末基金资产净值	5,071,229,526.30
期末基金份额净值	2.649
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	271.06%

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	6.86%	0.93%	4.13%	0.54%	2.73%	0.39%
过去三个月	4.46%	0.80%	4.69%	0.50%	-0.23%	0.30%
过去六个月	3.56%	0.74%	8.24%	0.46%	-4.68%	0.28%
过去一年	2.32%	0.77%	12.71%	0.54%	-10.39%	0.23%
过去三年	113.13%	1.85%	59.49%	1.40%	53.64%	0.45%
自成立以来	271.06%	1.75%	46.73%	1.25%	224.33%	0.50%

注：本基金业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数＋20%×中证国债指数，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：沪深 300 指数和中证国债指数具有较强的代表性。沪深 300 指数选择中国 A 股市场市值规模最大、流动性强和基本因素良好的 300 家上市公司作为样本股，充分反映了 A 股市场的行业代表性，描述了沪深 A 股市场的总体趋势，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中证国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

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)+20％×(中证国债指数 t / 中证国债指数 t-1 -1)

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

注：1、净值表现所取数据截至到 2017 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全轻资产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 2012 年 4 月 5 日至 2012 年 10 月 4 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		
谢治宇	基金管理部投资	2014 年 12 月 8 日	-	9 年	经济学硕士，2007 年加入

	副总监兼本基金、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理				兴全基金管理有限公司，历任行业研究员、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、《兴全轻资产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，市场结构性分化较大，大盘总体上涨，创业板指数下跌。在年初的机构调仓和乐视网事件等因素催化下，成长股开年即出现了一轮较大幅度下跌，同时宏观经济数据回暖、融资政策变化、AH 股互动加强以及混改、PPP、一带一路等自上而下政策催化等因素叠加，A 股投资者的投资风格偏好及选股标准发生了较大变化，投资者开始重新审视报表质量扎实、内生增长动力强劲的白马龙头价值，以及传统行业中持续积累竞争力、有望充分受益经济企稳回暖的边际改善类公司。此后二季度内公布的 2016 年报及 2017 年一季报，普遍验证了白马龙头业绩稳健甚至加速的突出竞争力特征，市场表现两极分化进一步加剧。整体看机构持仓配置结构经历了一个再平衡的过程，A 股市场投资评价方式正加速向国际市场接轨。本基金上半年总体仓位水平变化不大，对持仓结构进行了一定调整，增持了消费、保险、机械等估值合理、阶段性边际预期持续改善的偏传统行业，适当减持原持有的长期方向看好但短期估值偏高预期稳定性相对欠佳的成长股，以控制回撤。

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 3.56%，业绩比较基准收益率为 8.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前来看，优质白马风格仍然延续，市场表现两极分化进一步加剧。随着两极化进一步演变，不排除部分白马公司会开始有阶段性泡沫化的特征出现。与此同时，部分行业、模式及公司管理能力良好的高估值高成长、前期由于市场风格被边缘化的公司从中长期角度看，有望出现较好的市场配置机会，投资吸引力正逐渐显现，自下而上精选个股的策略较过去的配置性操作预期会更为有效。此外，我们积极关注宏观经济变量的变化，适当把握周期性相关行业的配置机会。总体上，我们仍然积极寻求以基本面为导向的中长期价值品种作为本基金核心持仓品种，坚定以为投资者创造中长期价值为根本。

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》、《兴全轻资产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，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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、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：兴全轻资产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	473,945,348.26	793,197,764.26
结算备付金		17,013,716.56	7,951,264.91
存出保证金		1,666,046.70	1,992,641.76
交易性金融资产	6.4.7.2	4,522,527,964.06	4,761,273,520.37
其中：股票投资		4,359,573,027.96	4,760,711,500.37
基金投资		-	-
债券投资		162,954,936.10	562,020.00
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	100,010,250.01	-
应收证券清算款		-	25,951,810.39
应收利息	6.4.7.5	2,202,475.56	163,814.97
应收股利		-	-
应收申购款		4,067,669.18	7,592,471.06

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,121,433,470.33	5,598,123,287.72
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		14,173,749.89	-
应付赎回款		24,874,585.67	12,824,051.74
应付管理人报酬		6,116,722.25	7,305,639.58
应付托管费		1,019,453.71	1,217,606.61
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,759,126.69	3,143,664.42
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	260,305.82	86,237.59
负债合计		50,203,944.03	24,577,199.94
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,914,611,549.62	2,178,447,320.55
未分配利润	6.4.7.10	3,156,617,976.68	3,395,098,767.23
所有者权益合计		5,071,229,526.30	5,573,546,087.78
负债和所有者权益总计		5,121,433,470.33	5,598,123,287.72

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.649 元，基金份额总额 1,914,611,549.62 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全轻资产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 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
一、收入		232,056,050.77	47,722,231.16
1.利息收入		4,674,512.50	2,457,358.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,473,213.69	1,467,142.29
债券利息收入		2,141,461.54	970,394.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,837.27	19,821.38
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-112,374,190.66	-113,145,456.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-149,841,366.20	-128,540,804.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,880,550.73	-1,376,410.70
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	28,586,624.81	16,771,758.34
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	335,681,975.59	153,537,735.77
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	4,073,753.34	4,872,593.57
减：二、费用		57,040,657.67	40,646,222.52
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	38,969,663.03	25,448,554.73

2．托管费	6.4.10.2.2	6,494,943.77	4,241,425.78
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	11,350,100.32	10,680,272.97
5．利息支出		-	54,386.10
其中：卖出回购金融资产支出		-	54,386.10
6．其他费用	6.4.7.20	225,950.55	221,582.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		175,015,393.10	7,076,008.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		175,015,393.10	7,076,008.64

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全轻资产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）	2,178,447,320.55	3,395,098,767.23	5,573,546,087.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	175,015,393.10	175,015,393.10
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	-263,835,770.93	-413,496,183.65	-677,331,954.58

列）			
其中：1.基金申购款	366,418,061.20	559,654,143.66	926,072,204.86
2.基金赎回款	-630,253,832.13	-973,150,327.31	-1,603,404,159.44
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）	1,914,611,549.62	3,156,617,976.68	5,071,229,526.30
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）	985,309,567.85	1,740,908,503.47	2,726,218,071.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,076,008.64	7,076,008.64
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）	1,037,933,733.45	1,467,264,851.26	2,505,198,584.71
其中：1.基金申购款	1,712,805,679.15	2,429,618,574.03	4,142,424,253.18
2.基金赎回款	-674,871,945.70	-962,353,722.77	-1,637,225,668.47
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	2,023,243,301.30	3,215,249,363.37	5,238,492,664.67

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：

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

兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)（原名兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)，以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]2161 号文《关于核准兴全轻资产投资股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2012 年 4 月 5 日正式生效，首次设立募集规模为 993,929,233.72 份基金份额。本基金为契约型上市开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金于 2015 年 8 月 7 日起更名为兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)。

本基金投资范围是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（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、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（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合轻资产理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数＋20%×中证国债指数。

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 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。

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	473,945,348.26
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	473,945,348.26

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		3,994,123,692.46	4,359,573,027.96	365,449,335.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	13,119,840.85	13,219,936.10	100,095.25

	银行间市场	150,082,300.00	149,735,000.00	-347,300.00
	合计	163,202,140.85	162,954,936.10	-247,204.75
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,157,325,833.31	4,522,527,964.06	365,202,130.75

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_银行间	100,010,250.01	-
合计	100,010,250.01	-

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	121,258.04
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	7,656.20

应收债券利息	2,060,564.96
应收买入返售证券利息	12,246.66
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	749.70
合计	2,202,475.56

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	3,758,876.68
银行间市场应付交易费用	250.01
合计	3,759,126.69

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	76,826.12
预提费用	183,479.70
其他	-
合计	260,305.82

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	2,178,447,320.55	2,178,447,320.55
本期申购	366,418,061.20	366,418,061.20
本期赎回(以"-"号填列)	-630,253,832.13	-630,253,832.13
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以"-"号填列)	-	-
本期末	1,914,611,549.62	1,914,611,549.62

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	2,592,071,638.40	803,027,128.83	3,395,098,767.23
本期利润	-160,666,582.49	335,681,975.59	175,015,393.10
本期基金份额交易产生的变动数	-304,616,281.33	-108,879,902.32	-413,496,183.65
其中：基金申购款	423,226,561.38	136,427,582.28	559,654,143.66
基金赎回款	-727,842,842.71	-245,307,484.60	-973,150,327.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,126,788,774.58	1,029,829,202.10	3,156,617,976.68

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	2,400,172.00
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	59,151.02
其他	13,890.67
合计	2,473,213.69

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	4,685,413,801.45
减：卖出股票成本总额	4,835,255,167.65
买卖股票差价收入	-149,841,366.20

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	8,880,550.73
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	8,880,550.73

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	171,497,291.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	161,925,337.04
减：应收利息总额	691,403.25
买卖债券差价收入	8,880,550.73

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

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

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	28,586,624.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	28,586,624.81

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	335,681,975.59
——股票投资	335,875,766.03
——债券投资	-193,790.44
——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	335,681,975.59

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	3,871,434.67
转换费收入	202,318.67
其他	-
合计	4,073,753.34

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	11,349,275.32
银行间市场交易费用	825.00

合计	11,350,100.32

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	39,671.58
信息披露费	143,808.12
账户维护费用	18,800.00
银行费用	23,670.85
其他	-
合计	225,950.55

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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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 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	324,924,203.00	3.76%	1,268,118,663.83	14.45%

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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	307,263.59	5.21%	222,103.46	5.91%
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	1,185,426.55	17.98%	616,645.72	16.67%

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	38,969,663.03	25,448,554.73
其中：支付销售机构的客户维护费	13,483,665.93	6,802,120.12

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 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托管费	6,494,943.77	4,241,425.78

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（ 2012 年 4 月 5 日 ）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,772,792.36	4,772,792.36
期间申购/买入总份额	-	-
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	4,772,792.36	4,772,792.36
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2493%	0.2359%

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

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	473,945,348.26	2,400,172.00	428,871,643.71	1,385,829.81

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
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	14,149,444	89,000,002.76	147,154,217.60	-
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	2,439,025	140,000,035.00	121,829,298.75	-
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	3,410,641	49,999,997.06	51,023,189.36	-
600604	市北	2016 年	2017	非公	15.31	7.15	3,265,839	49,999,995.09	23,350,748.85	-

	高新	8 月 31 日	年 8 月 29 日	开发行流通受限						
600604	市北高新	2017 年 5 月 26 日	2017 年 8 月 29 日	非公开发行流通受限-转增	-	7.15	3,265,839	-	23,350,748.85	注 1
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	3,046,922	49,999,990.02	36,898,225.42	-
002131	利欧股份	2016 年 9 月 8 日	2017 年 9 月 11 日	非公开发行流通受限	17.39	3.29	2,875,215	49,999,988.85	9,459,457.35	-
002131	利欧股份	2017 年 6 月 13 日	2017 年 9 月 11 日	非公开发行流通受限-转增	-	3.29	7,188,038	-	23,648,645.02	注 2
601137	博威合金	2016 年 8 月 18 日	2017 年 8 月 18	非公开发行流	11.20	11.33	525,793	5,888,881.60	5,957,234.69	-

			日	通受限						
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 3
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	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-

			日							
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 年度权益分派，向全体股东每股派发现金红利 0.02 元；同时，以资本公积金向全体股东每股转增 1 股。

2、本基金持有的非公开发行股票利欧股份，于 2017 年 6 月 13 日实施 2016 年度权益分派，向全体股东每 10 股派发现金红利 0.37 元；同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 25 股。

3、本基金持有的新股流通受限股票凯莱英，于 2017 年 6 月 14 日实施 2016 年度权益分派，向全体股东每 10 股派发现金红利 5.00 元；同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 10 股。

4、流通受限证券可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000403	ST 生化	2017 年 6 月 21 日	筹划重大事项	30.93	-	-	2,464,216	70,075,565.47	76,218,200.88	-
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	3,764,027	72,474,530.98	62,445,207.93	-
300100	双林股份	2017 年 4 月 5 日	筹划重大事项	25.96	-	-	90,300	2,359,918.00	2,344,188.00	-

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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.3.2.1 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	473,945,348.26	-	-	-	-	-	473,945,348.26
结算备付金	17,013,716.56	-	-	-	-	-	17,013,716.56
存出保证金	1,666,046.70	-	-	-	-	-	1,666,046.70
交易性金融资产	-	-	149,735,000.00	12,840,592.00	379,344.10	4,359,573,027.96	4,522,527,964.06
买入返售金融资产	100,010,250.01	-	-	-	-	-	100,010,250.01
应收利息	-	-	-	-	-	2,202,475.56	2,202,475.56
应收申购款	7,505.93	-	-	-	-	4,060,163.25	4,067,669.18
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	592,642,867.46	-	149,735,000.00	12,840,592.00	379,344.10	4,365,835,666.77	5,121,433,470.33
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,173,749.89	14,173,749.89
应付赎	-	-	-	-	-	24,874,585.67	24,874,585.67

回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,116,722.25	6,116,722.25
应付托管费	-	-	-	-	-	1,019,453.71	1,019,453.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,759,126.69	3,759,126.69
其他负债	-	-	-	-	-	260,305.82	260,305.82
负债总计	-	-	-	-	-	50,203,944.03	50,203,944.03
利率敏感度缺口	592,642,867.46	-	149,735,000.00	12,840,592.00	379,344.10	4,315,631,722.74	5,071,229,526.30
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	793,197,764.26	-	-	-	-	-	793,197,764.26
结算备付金	7,951,264.91	-	-	-	-	-	7,951,264.91
存出保证金	1,992,641.76	-	-	-	-	-	1,992,641.76
交易性金融资	-	-	-	-	562,020.00	4,760,711,500.37	4,761,273,520.37

产							
应收证券清算款	-	-	-	-	-	25,951,810.39	25,951,810.39
应收利息	-	-	-	-	-	163,814.97	163,814.97
应收申购款	29,671.40	-	-	-	-	7,562,799.66	7,592,471.06
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	803,171,342.33	-	-	-	562,020.00	4,794,389,925.39	5,598,123,287.72
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,824,051.74	12,824,051.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,305,639.58	7,305,639.58
应付托管费	-	-	-	-	-	1,217,606.61	1,217,606.61
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,143,664.42	3,143,664.42
其他负债	-	-	-	-	-	86,237.59	86,237.59
负债总计	-	-	-	-	-	24,577,199.94	24,577,199.94
利率敏感度缺口	803,171,342.33	-	-	-	562,020.00	4,769,812,725.45	5,573,546,087.78

6.4.13.3.2.2 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%	-655,925.73	-
	利率 -1%	661,802.84	-

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。

6.4.13.3.3 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。

6.4.13.3.4 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、权证、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（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.3.4.1 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	4,359,573,027.96	85.97	4,760,711,500.37	85.42
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	162,954,936.10	3.21	562,020.00	0.01
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	4,522,527,964.06	89.18	4,761,273,520.37	85.43

6.4.13.3.4.2 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%	-556,548,970.40	-452,615,650.84
	业绩比较基准+10%	556,548,970.40	452,615,650.84

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。

6.4.13.3.5 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	4,359,573,027.96	85.12
	其中：股票	4,359,573,027.96	85.12
2	固定收益投资	162,954,936.10	3.18
	其中：债券	162,954,936.10	3.18
	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	100,010,250.01	1.95
	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	490,959,064.82	9.59
7	其他各项资产	7,936,191.44	0.15
8	合计	5,121,433,470.33	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	2,437,767,934.49	48.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	426,568,942.00	8.41
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	270,131,514.28	5.33
J	金融业	1,067,835,211.25	21.06
K	房地产业	46,701,497.70	0.92
L	租赁和商务服务业	36,898,225.42	0.73
M	科学研究和技术服务业	73,669,702.82	1.45
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	4,359,573,027.96	85.97

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	10,124,423	502,272,625.03	9.90
2	601601	中国太保	11,000,746	372,595,267.02	7.35
3	000858	五 粮 液	6,083,564	338,611,172.24	6.68
4	000423	东阿阿胶	3,976,296	285,855,919.44	5.64
5	600104	上汽集团	8,979,987	278,828,596.35	5.50
6	600690	青岛海尔	16,150,173	243,060,103.65	4.79
7	601336	新华保险	3,754,228	192,967,319.20	3.81
8	002174	游族网络	5,473,866	173,849,984.16	3.43
9	000063	中兴通讯	6,810,301	161,676,545.74	3.19
10	300054	鼎龙股份	15,782,490	160,507,923.30	3.17
11	000413	东旭光电	14,149,444	147,154,217.60	2.90
12	600335	国机汽车	11,220,547	134,197,742.12	2.65
13	603589	口子窖	3,389,344	131,472,653.76	2.59
14	601933	永辉超市	17,659,094	125,026,385.52	2.47
15	002594	比亚迪	2,439,025	121,829,298.75	2.40
16	002024	苏宁云商	10,339,700	116,321,625.00	2.29
17	000403	ST 生化	2,464,216	76,218,200.88	1.50
18	002117	东港股份	2,891,646	74,835,798.48	1.48
19	300271	华宇软件	3,764,027	62,445,207.93	1.23
20	601689	拓普集团	1,740,761	58,298,085.89	1.15
21	300284	苏交科	2,830,893	55,711,974.24	1.10
22	002850	科达利	601,847	54,641,689.13	1.08
23	603003	龙宇燃油	3,410,641	51,023,189.36	1.01
24	002250	联化科技	3,535,324	50,555,133.20	1.00
25	600305	恒顺醋业	4,804,451	49,293,667.26	0.97
26	600584	长电科技	2,984,639	47,903,455.95	0.94
27	300009	安科生物	2,889,952	47,424,112.32	0.94

28	600604	市北高新	6,531,678	46,701,497.70	0.92
29	002570	贝因美	3,309,335	45,006,956.00	0.89
30	603117	万林股份	3,046,922	36,898,225.42	0.73
31	002131	利欧股份	10,063,253	33,108,102.37	0.65
32	603899	晨光文具	1,801,127	31,339,609.80	0.62
33	300308	中际装备	475,228	19,546,127.64	0.39
34	603018	中设集团	554,422	17,957,728.58	0.35
35	601137	博威合金	525,793	5,957,234.69	0.12
36	002821	凯莱英	42,818	3,124,429.46	0.06
37	300100	双林股份	90,300	2,344,188.00	0.05
38	603823	百合花	36,764	778,661.52	0.02
39	300508	维宏股份	10,383	720,580.20	0.01
40	002859	洁美科技	6,666	486,618.00	0.01
41	002860	星帅尔	7,980	390,222.00	0.01
42	603833	欧派家居	2,329	255,863.94	0.01
43	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
44	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
45	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
46	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
47	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
48	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
49	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
50	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
51	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
52	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
53	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
54	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
55	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00

56	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
57	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
58	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
59	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
60	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
61	002582	好想你	56	673.12	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	511,798,362.82	9.18
2	601601	中国太保	359,760,894.30	6.45
3	002027	分众传媒	299,744,404.17	5.38
4	000858	五 粮 液	260,970,343.89	4.68
5	600104	上汽集团	254,760,223.10	4.57
6	600690	青岛海尔	214,362,287.34	3.85
7	601336	新华保险	205,893,722.53	3.69
8	002174	游族网络	176,623,607.87	3.17
9	002142	宁波银行	154,801,092.77	2.78
10	603589	口子窖	124,800,048.85	2.24
11	000063	中兴通讯	123,708,775.71	2.22
12	601933	永辉超市	112,009,216.50	2.01
13	600060	海信电器	106,597,079.36	1.91
14	601328	交通银行	93,841,460.18	1.68
15	600031	三一重工	75,105,477.25	1.35

16	600596	新安股份	69,524,792.19	1.25
17	601997	贵阳银行	68,555,273.51	1.23
18	300009	安科生物	59,051,702.64	1.06
19	600827	百联股份	56,679,104.01	1.02
20	002850	科达利	56,183,350.26	1.01

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	600309	万华化学	350,330,955.37	6.29
2	002027	分众传媒	318,000,806.02	5.71
3	300012	华测检测	241,065,487.12	4.33
4	600584	长电科技	237,837,193.25	4.27
5	601997	贵阳银行	192,031,193.45	3.45
6	600031	三一重工	181,598,810.47	3.26
7	002582	好想你	174,213,243.68	3.13
8	002425	凯撒文化	170,394,626.21	3.06
9	000858	五 粮 液	165,584,326.50	2.97
10	002142	宁波银行	143,402,894.42	2.57
11	300271	华宇软件	141,645,238.42	2.54
12	002299	圣农发展	122,553,059.95	2.20
13	000425	徐工机械	113,630,998.61	2.04
14	601318	中国平安	109,325,422.37	1.96
15	600060	海信电器	102,307,719.78	1.84
16	300054	鼎龙股份	94,176,526.84	1.69
17	000157	中联重科	93,410,280.04	1.68

18	600500	中化国际	92,425,915.45	1.66
19	601328	交通银行	89,807,866.29	1.61
20	600882	广泽股份	88,318,092.15	1.58

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	4,098,240,929.21
卖出股票收入（成交）总额	4,685,413,801.45

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,735,000.00	2.95
	其中：政策性金融债	149,735,000.00	2.95
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）	13,219,936.10	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	162,954,936.10	3.21

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	150201	15 国开 01	1,000,000	99,990,000.00	1.97
2	100412	10 农发 12	500,000	49,745,000.00	0.98
3	113008	电气转债	69,170	7,183,996.20	0.14
4	110031	航信转债	49,710	5,142,002.40	0.10
5	113010	江南转债	4,930	514,593.40	0.01

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	1,666,046.70
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,202,475.56
5	应收申购款	4,067,669.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,936,191.44

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	113008	电气转债	7,183,996.20	0.14

2	110031	航信转债	5,142,002.40	0.10
3	113010	江南转债	514,593.40	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

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
226,038	8,470.31	224,855,729.83	11.74%	1,689,755,819.79	88.26%

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	平安聚睿股票型 FOF 养老金产品－中国工商银行股份有限公司	1,523,302.00	1.94%
2	蒋剑松	1,462,270.00	1.87%
3	陈荣新	1,200,020.00	1.53%
4	方劲戎	921,412.00	1.18%
5	杨亚云	790,000.00	1.01%

6	韩艳华	700,000.00	0.89%
7	刘宝文	696,593.00	0.89%
8	陈翠芳	689,306.00	0.88%
9	李燕群	681,500.00	0.87%
10	任莉娟	575,000.00	0.73%

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	1,808,926.38	0.0945%

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	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2012 年 4 月 5 日 ）基金份额总额	993,929,233.72
本报告期期初基金份额总额	2,178,447,320.55
本报告期基金总申购份额	366,418,061.20
减:本报告期基金总赎回份额	630,253,832.13
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	1,914,611,549.62

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	
中金公司	2	2,662,351,121.59	30.81%	1,680,745.45	28.52%	-
国信证券	2	1,850,932,180.73	21.42%	1,240,028.70	21.04%	新增
广发证券	2	1,817,795,263.18	21.04%	1,301,528.29	22.08%	新增
南京证券	1	814,418,704.35	9.43%	514,143.74	8.72%	-
安信证券	2	555,088,460.63	6.42%	405,933.90	6.89%	-
华创证券	1	352,896,050.93	4.08%	258,070.88	4.38%	-
兴业证券	2	324,924,203.00	3.76%	307,263.59	5.21%	-
国泰君安	2	115,552,421.33	1.34%	84,502.82	1.43%	-
信达证券	2	56,777,211.60	0.66%	41,521.34	0.70%	-
国金证券	2	56,156,321.08	0.65%	35,452.15	0.60%	-
银河证券	1	33,382,237.06	0.39%	24,411.30	0.41%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-

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
中金公司	37,783,125.16	19.68%	-	-	-	-
国信证券	94,477,383.25	49.22%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	2,152,960.00	1.12%	-	-	-	-
安信证券	22,887,304.99	11.92%	-	-	-	-
华创证券	34,638,948.90	18.05%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

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	关于增加长城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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 1 月 10 日
3	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
4	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
5	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
6	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 1 月 25 日
7	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
8	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
9	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	2017 年 2 月 15 日

		金管理人网站	
10	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 2 月 23 日
11	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
12	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、证券时报、基金管理人网站	2017 年 3 月 9 日
13	兴全基金管理有限公司关于基金网上直销平台开展通联支付渠道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 9 日
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	关于恢复接受兴全轻资产投资混	中国证券报、上海证	2017 年 4 月 15 日

	合型证券投资基金（LOF）一百万元以上申购和转换转入申请的公告	券报、证券时报、基金管理人网站	
20	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
21	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
22	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
23	关于设立厦门分公司的公告	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 2 日
24	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
25	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
26	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
27	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、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》

3、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

4、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）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