

# 兴全全球视野股票型证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 3 月 27 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。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	兴全全球视野股票
基金主代码	340006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 9 月 20 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	866,915,372.34 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴全基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	龚小武
	联系电话	021-20398888	021-52629999-212056
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	011597@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyfunds.com.cn">http://www.xyfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所



## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-216,388,123.80	-86,787,778.37	166,818,837.74
本期利润	-358,557,786.59	-60,462,292.68	-451,651,339.63
加权平均基金份额本期利润	-0.3796	-0.0452	-0.2396
本期基金份额净值增长率	-22.77%	-0.74%	-11.90%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.2849	0.6638	0.6762
期末基金资产净值	1,113,865,987.67	1,565,679,052.78	3,011,926,782.72
期末基金份额净值	1.2849	1.6638	1.6762

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。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去三个月	-9.69%	1.70%	-9.50%	1.31%	-0.19%	0.39%
过去六个月	-19.25%	1.69%	-10.85%	1.20%	-8.40%	0.49%
过去一年	-22.77%	1.58%	-19.51%	1.07%	-3.26%	0.51%
过去三年	-32.47%	1.43%	-13.82%	0.94%	-18.65%	0.49%
过去五年	23.14%	1.64%	29.34%	1.21%	-6.20%	0.43%
自基金合同生效起至今	384.04%	1.52%	122.39%	1.41%	261.65%	0.11%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证

国债指数是一个全面反映国债市场（包括银行间、上交所、深交所）的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

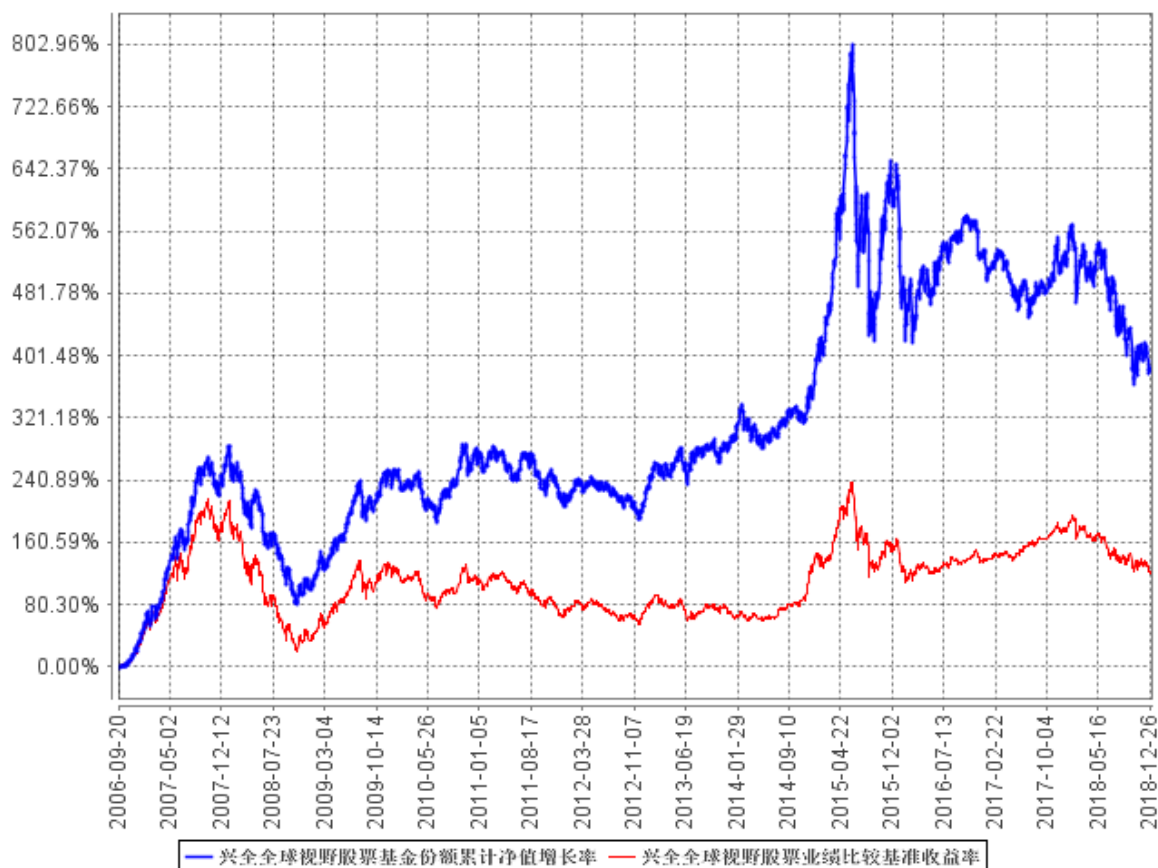
$$\text{Return } t = 80\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数 } t-1 - 1) + 15\% \times (\text{中证国债指数 } t / \text{中证国债指数 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率 } t / 360)$$

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

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

兴全全球视野股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

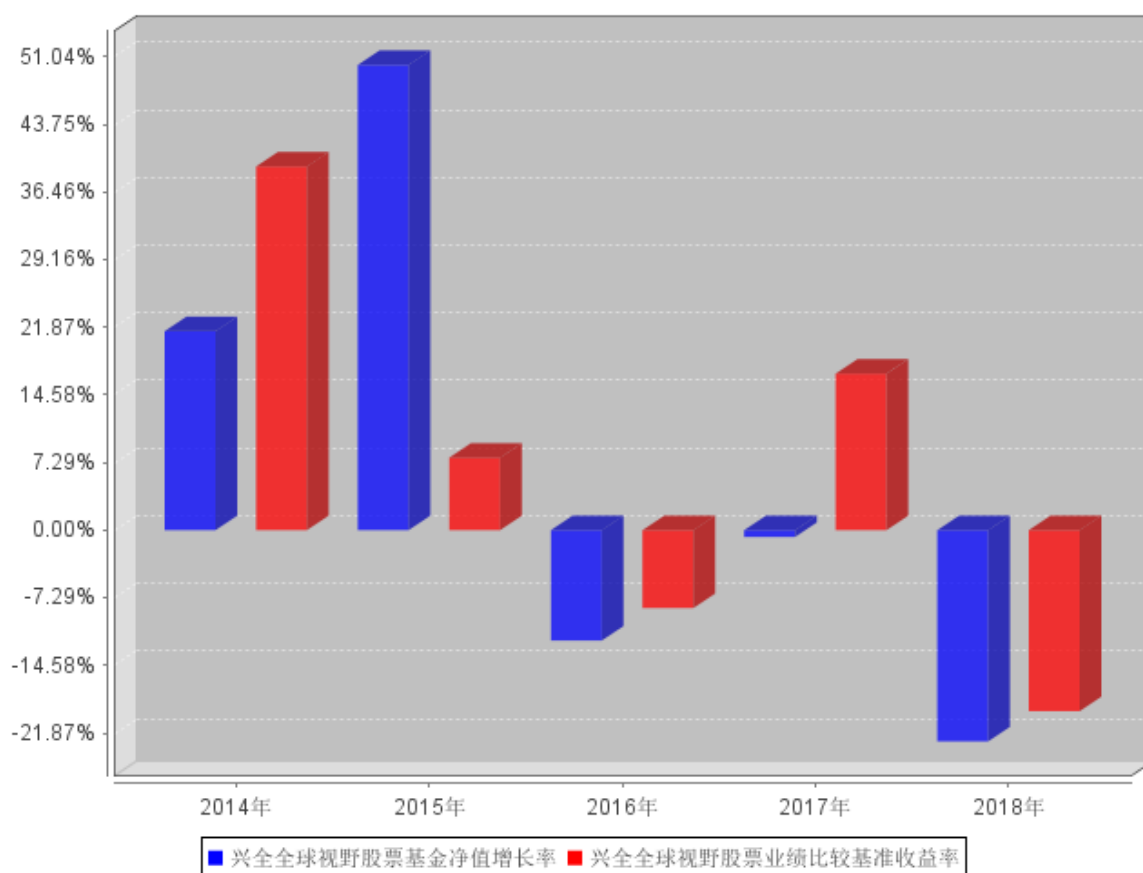


注：1、净值表现所取数据截至到 2018 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2006 年 9 月 20 日至 2007 年 3 月 19 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全全球视野股票过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	-	-	-	-	
2017	-	-	-	-	
2016	4.800	2,250,165,339.95	276,699,140.85	2,526,864,480.80	
合计	4.800	2,250,165,339.95	276,699,140.85	2,526,864,480.80	

## § 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2018年12月31日，公司旗下管理着二十二只基金，分别为兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
王品	基金管理部总监助理、本基金基金经理	2017年9月19日	-	19年	理学硕士，历任兴业证券研发中心医药行业研究员、研究报告内核组组长，中银国际基金管理公司医药、化工、石化行业研究员，汇丰晋信基金管理有限公司医



					药、房地产行业高级研究员、基金经理、投资副总监，兴全基金管理有限公司专户投资部总监助理兼投资经理。
--	--	--	--	--	---

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴全基金管理有限公司公平交易制度》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

2018 年市场较为惨淡，A 股市场出现了全线下跌，其中沪深 300 指数年度跌幅为 25.31%，创业板指数年度跌幅为 28.65%。导致市场出现较大跌幅的主要原因是：在流动性方面，央行与监管层推出了“宽货币、紧信用”的政策组合，虽然多次降低了存款准备金率，货币环境有所宽松，

但在金融领域坚定地去杠杆，国内社融增速明显放缓，企业信用风险陡然上升，部分企业资金链出现了一定问题；在经济基本面方面，社融增速的下行逐步对经济增速产生了影响，年度 GDP 增速下行了 0.3 个百分点至 6.6%，企业盈利增速也出现了明显的下滑；同时，中美贸易战逐步向纵深方向发展，投资者对于未来的经济增长产生了较为负面的悲观预期；在流动性与盈利能力双重不利因素的影响下，市场出现了较大的跌幅。

2018 年本基金主要重仓了医药、计算机、地产等行业，上半年本基金由于对于市场相对乐观，组合策略相对积极，下半年考虑到宏观经济的下行趋势明显，本基金的组合策略以防守为主，组合策略以逆周期和早周期的行业配置为主，此外，本基金依然重视自下而上的精选个股策略。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2849 元；本报告期基金份额净值增长率为-22.77%，业绩比较基准收益率为-19.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们认为，目前市场对于经济增速下行和企业盈利增速下滑已经有着较为一致的预期，变数在于两个变量，一是社会融资总额增速是否能逐步企稳，若能企稳，投资者对于企业盈利的预期将有所改观，当前管理层正在着力引导宽松的政策由货币向信用方向传导，我们看到，无论货币还是财政政策仍有一定扩张空间，预计在各方的努力下，社融增速将逐步企稳；二是中美贸易战的谈判能否达成一个有利于中国发展的协议，这将对中国的技术创新能力、出口创汇能力产生深远的影响，从目前官方媒体获得的信息，事态似乎正在朝积极的方面发展。基于此，我们对于 2019 年的 A 股市场走势相对乐观。

在投资策略上，2019 年将重点关注一些盈处能力不受经济周期影响的行业与个股，在组合的构建上将更为注重企业的商业模式、管理层的经营能力、估值的匹配度等以期获得较好的投资回报率。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重

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

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《基金法》、《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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《兴全全球视野股票型证券投资基金基金合同》与《兴全全球视野股票型证券投资基金托管协议》，自 2006 年 9 月 20 日起托管兴业全球视野（即更名后的“兴全全球视野”）股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本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 审计报告

本报告期基金财务报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师(汪芳)、(侯雯)签字出具了(标准无保留意见)(德师报(审)字(19)第 P01808 号)标准无保留意见的审计报告。投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全全球视野股票型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	33,279,304.53	35,429,337.85
结算备付金		3,818,116.94	4,417,401.77
存出保证金		1,008,811.91	859,286.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,070,528,894.55	1,530,423,749.36
其中：股票投资		966,076,671.43	1,456,660,620.06
基金投资		-	-
债券投资		104,452,223.12	73,763,129.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,656,352.68	9,470,248.39
应收利息	7.4.7.5	2,527,183.75	1,727,199.93
应收股利		-	-
应收申购款		321,687.69	537,536.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,118,140,352.05	1,582,864,759.88
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	8,235,975.33
应付赎回款		504,679.95	3,239,314.25
应付管理人报酬		1,456,667.76	1,991,795.70
应付托管费		242,777.96	331,965.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,733,292.65	3,074,465.63
应交税费		232.63	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	336,713.43	312,190.24
负债合计		4,274,364.38	17,185,707.10
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	866,915,372.34	941,001,756.24
未分配利润	7.4.7.10	246,950,615.33	624,677,296.54
所有者权益合计		1,113,865,987.67	1,565,679,052.78
负债和所有者权益总计		1,118,140,352.05	1,582,864,759.88

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2849 元，基金份额总额 866,915,372.34 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全全球视野股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		-319,015,344.89	-9,561,544.29
1. 利息收入		4,199,272.29	4,012,709.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,090,928.78	1,267,634.99
债券利息收入		3,051,486.57	2,623,469.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,856.94	121,605.37
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-181,270,104.38	-40,930,569.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-200,517,147.90	-56,447,174.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-365,523.69	2,008,121.32
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	19,612,567.21	13,508,484.17
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-142,169,662.79	26,325,485.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	225,149.99	1,030,829.11
<b>减：二、费用</b>		39,542,441.70	50,900,748.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	21,709,996.51	32,435,493.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,618,332.79	5,405,915.67
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	13,830,547.58	12,684,273.84
5. 利息支出		8,493.26	-
其中：卖出回购金融资产支出		8,493.26	-
6. 税金及附加		497.14	-
7. 其他费用	7.4.7.20	374,574.42	375,065.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-358,557,786.59	-60,462,292.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-358,557,786.59	-60,462,292.68

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全全球视野股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	941,001,756.24	624,677,296.54	1,565,679,052.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-358,557,786.59	-358,557,786.59
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）	-74,086,383.90	-19,168,894.62	-93,255,278.52
其中：1. 基金申购款	216,396,294.42	127,613,854.80	344,010,149.22
2. 基金赎回款	-290,482,678.32	-146,782,749.42	-437,265,427.74
五、期末所有者权益（基金净值）	866,915,372.34	246,950,615.33	1,113,865,987.67
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）	1,796,910,963.78	1,215,015,818.94	3,011,926,782.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	-60,462,292.68	-60,462,292.68



润)			
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)	-855,909,207.54	-529,876,229.72	-1,385,785,437.26
其中：1. 基金申购款	203,928,827.29	122,457,565.15	326,386,392.44
2. 基金赎回款	-1,059,838,034.83	-652,333,794.87	-1,712,171,829.70
五、期末所有者权益(基金净值)	941,001,756.24	624,677,296.54	1,565,679,052.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全全球视野股票型证券投资基金(原名兴业全球视野股票型证券投资基金,以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]149号文《关于同意兴业全球视野股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行人募集,基金合同于2006年9月20日正式生效,首次设立募集规模为3,289,724,684.59份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴全基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴全全球视野股票型证券投资基金。

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

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

本基金的业绩比较基准为:自2015年9月21日起,本基金业绩比较基准由“80%×中信标普300指数+15%×中信标普国债指数+5%×同业存款利率”变更为“80%×沪深300指数+15%×中证国债指数+5%×同业存款利率”。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

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

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

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

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
兴业证券	1,826,958,502.54	19.27%	2,292,210,966.36	27.31%

### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	31,644,134.75	28.66%	4,986,258.24	2.47%

### 7.4.8.1.3 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。

### 7.4.8.1.4 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。

### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31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	1,336,221.24	16.36%	290,573.02	16.76%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	1,664,443.38	23.57%	860,705.27	28.00%

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。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	21,709,996.51	32,435,493.88

其中：支付销售机构的客户维护费	3,706,703.99	4,423,772.15
-----------------	--------------	--------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 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×1.50%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,618,332.79	5,405,915.67

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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

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。

##### 7.4.8.4.2 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投资本基金。

#### 7.4.8.5 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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	33,279,304.53	1,003,103.85	35,429,337.85	1,209,117.70

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

7.4.12.1.1 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
002048	宁波华翔	2017年12月27日	2019年12月30日	非公开发行流通受限	21.25	9.52	705,882	14,999,992.50	6,719,996.64	-
601860	紫金银行	2018年12月20日	2019年1月3日	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-
603156	养元饮品	2018年2月2日	2019年2月12日	老股转让锁定	78.73	40.68	37,717	2,969,459.41	1,534,327.56	-
603156	养元饮品	2018年5月8日	2019年2月12日	老股转让锁定-送股	-	40.68	15,087	-	613,739.16	注1
601138	工业富联	2018年5月28日	2019年6月10日	新股流通受限	13.77	10.97	398,404	5,486,023.08	4,370,491.88	-
300271	华宇软件	2018年10月19日	2019年4月19日	大宗交易购入流通受限	11.75	14.21	1,000,000	11,750,000.00	14,210,000.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	值单价	(单位:张)	成本总额		
110049	海尔转债	2018年12月20日	2019年1月18日	新发行未上市	100.00	100.00	4,320	432,000.00	432,000.00	-
113525	台华转债	2018年12月19日	2019年1月11日	新发行未上市	100.00	100.00	19,810	1,981,000.00	1,981,000.00	-

注 1: 本基金持有的老股转让股票养元饮品, 于 2018 年 5 月 8 日实施 2017 年度权益分配方案, 向全体股东每股派发现金股利人民币 2.6 元(含税); 同时, 向全体股东每股派送红股 0.4 股。本基金新增 15,087 股。

注 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。

#### 7.4.9.2 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
600030	中信证券	2018年12月25日	重大事项停牌	16.01	2019年1月10日	17.15	93,351	1,793,100.93	1,494,549.51	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 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。

##### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允

价值接近。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 955, 471, 171. 20 元, 第二层次的余额为 115, 057, 723. 35 元, 无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日: 第一层次 1, 230, 853, 348. 73 元, 第二层次的余额为 299, 570, 400. 63 元, 无属于第三层次的余额)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值, 相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额



## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	966,076,671.43	86.40
	其中：股票	966,076,671.43	86.40
3	固定收益投资	104,452,223.12	9.34
	其中：债券	104,452,223.12	9.34
7	银行存款和结算备付金合计	37,097,421.47	3.32
8	其他各项资产	10,514,036.03	0.94
9	合计	1,118,140,352.05	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
C	制造业	332,969,847.51	29.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,018,442.28	7.09
E	建筑业	55,574,077.72	4.99
F	批发和零售业	51,454,146.47	4.62
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,833,209.14	14.53
J	金融业	17,419,200.11	1.56
K	房地产业	128,310,177.32	11.52
M	科学研究和技术服务业	34,646,317.09	3.11
R	文化、体育和娱乐业	104,851,253.79	9.41
	合计	966,076,671.43	86.73

#### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	596,835	104,446,125.00	9.38

2	300271	华宇软件	6,587,782	98,082,607.82	8.81
3	600011	华能国际	10,707,106	79,018,442.28	7.09
4	300144	宋城演艺	3,606,634	77,001,635.90	6.91
5	600048	保利地产	5,351,053	63,088,914.87	5.66
6	300760	迈瑞医疗	517,493	56,520,585.46	5.07
7	601186	中国铁建	3,772,600	41,008,162.00	3.68
8	600038	中直股份	1,002,867	37,467,111.12	3.36
9	000002	万科A	1,486,800	35,415,576.00	3.18
10	002727	一心堂	1,745,049	31,026,971.22	2.79

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	213,360,412.46	13.63
2	001979	招商蛇口	206,305,929.55	13.18
3	002456	欧菲光	197,331,032.50	12.60
4	002262	恩华药业	177,527,978.35	11.34
5	002677	浙江美大	174,643,462.77	11.15
6	600048	保利地产	151,732,824.95	9.69
7	600028	中国石化	142,500,143.00	9.10
8	600690	青岛海尔	136,154,940.02	8.70
9	300271	华宇软件	125,134,512.86	7.99
10	002727	一心堂	119,229,359.54	7.62
11	601601	中国太保	102,556,407.46	6.55
12	600011	华能国际	101,117,039.77	6.46
13	601398	工商银行	92,946,906.50	5.94
14	300144	宋城演艺	90,995,528.00	5.81
15	600519	贵州茅台	89,052,181.19	5.69
16	300059	东方财富	83,938,852.01	5.36
17	000661	长春高新	83,118,102.48	5.31
18	600030	中信证券	81,129,620.22	5.18
19	601012	隆基股份	76,108,159.10	4.86
20	600703	三安光电	74,095,009.15	4.73

21	002475	立讯精密	68,516,791.25	4.38
22	300760	迈瑞医疗	68,180,972.05	4.35
23	000002	万科 A	67,307,789.49	4.30
24	600104	上汽集团	66,976,403.23	4.28
25	603368	柳药股份	66,529,359.15	4.25
26	002179	中航光电	55,746,539.09	3.56
27	600038	中直股份	53,499,363.34	3.42
28	601933	永辉超市	51,668,272.94	3.30
29	600183	生益科技	47,227,818.84	3.02
30	300009	安科生物	46,285,930.63	2.96
31	002008	大族激光	44,900,480.90	2.87
32	600031	三一重工	44,128,813.35	2.82
33	601288	农业银行	43,746,215.60	2.79
34	601186	中国铁建	41,205,558.36	2.63
35	000963	华东医药	40,780,881.84	2.60
36	601088	中国神华	39,994,411.78	2.55
37	600188	兖州煤业	39,934,976.60	2.55
38	002653	海思科	39,562,501.81	2.53
39	600352	浙江龙盛	38,706,674.72	2.47
40	300274	阳光电源	38,095,342.42	2.43
41	300122	智飞生物	36,439,031.94	2.33
42	601799	星宇股份	36,264,874.89	2.32
43	300413	芒果超媒	35,044,626.28	2.24
44	300642	透景生命	33,317,152.58	2.13
45	002668	奥马电器	33,295,556.84	2.13
46	300012	华测检测	32,789,066.20	2.09
47	601111	中国国航	32,619,129.64	2.08
48	000651	格力电器	32,513,006.00	2.08
49	601233	桐昆股份	31,794,313.01	2.03

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。

#### 8.4.2 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	601318	中国平安	253,714,054.74	16.20
2	600690	青岛海尔	243,650,745.55	15.56

3	600048	保利地产	160,516,234.65	10.25
4	001979	招商蛇口	159,141,276.97	10.16
5	002456	欧菲光	153,891,200.23	9.83
6	000661	长春高新	147,001,612.66	9.39
7	600519	贵州茅台	135,347,387.81	8.64
8	600028	中国石化	133,497,823.22	8.53
9	002677	浙江美大	121,581,324.66	7.77
10	600887	伊利股份	111,983,097.38	7.15
11	002262	恩华药业	110,564,162.72	7.06
12	300059	东方财富	105,188,355.22	6.72
13	601601	中国太保	99,831,972.13	6.38
14	601398	工商银行	86,315,150.02	5.51
15	002008	大族激光	85,449,135.17	5.46
16	300271	华宇软件	84,783,929.52	5.42
17	300054	鼎龙股份	83,962,822.43	5.36
18	002727	一心堂	81,010,709.32	5.17
19	600030	中信证券	78,520,925.55	5.02
20	600703	三安光电	70,968,648.77	4.53
21	002475	立讯精密	70,572,914.13	4.51
22	600036	招商银行	70,332,993.32	4.49
23	601012	隆基股份	69,400,121.11	4.43
24	603589	口子窖	65,037,059.51	4.15
25	600104	上汽集团	64,373,510.82	4.11
26	600340	华夏幸福	56,199,371.00	3.59
27	300009	安科生物	54,622,356.44	3.49
28	002179	中航光电	53,751,415.99	3.43
29	603368	柳药股份	52,878,757.04	3.38
30	000963	华东医药	46,179,948.49	2.95
31	601799	星宇股份	46,121,615.72	2.95
32	601288	农业银行	43,277,528.68	2.76
33	600038	中直股份	42,778,680.95	2.73
34	300251	光线传媒	42,678,840.55	2.73
35	600031	三一重工	42,112,565.84	2.69
36	600183	生益科技	37,437,086.13	2.39
37	300122	智飞生物	36,302,807.07	2.32
38	601088	中国神华	35,968,900.82	2.30
39	601111	中国国航	35,857,039.88	2.29
40	600352	浙江龙盛	35,709,631.87	2.28

41	300383	光环新网	34,265,101.17	2.19
42	600060	海信电器	34,084,028.34	2.18
43	002668	奥马电器	33,982,633.85	2.17
44	000858	五粮液	33,938,459.73	2.17
45	603708	家家悦	33,809,971.37	2.16
46	300012	华测检测	33,480,955.44	2.14
47	300308	中际旭创	32,017,585.04	2.04
48	601933	永辉超市	31,994,332.16	2.04
49	601233	桐昆股份	31,882,171.20	2.04

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。

### 8.4.3 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	4,673,848,477.76
卖出股票收入（成交）总额	4,821,833,559.78

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。

### 8.5 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（%）
3	金融债券	83,651,472.80	7.51
	其中：政策性金融债	83,651,472.80	7.51
7	可转债（可交换债）	20,800,750.32	1.87
10	合计	104,452,223.12	9.38

### 8.6 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	140435	14 农发 35	700,000	70,532,000.00	6.33
2	018005	国开 1701	130,620	13,119,472.80	1.18
3	123006	东财转债	54,460	6,316,815.40	0.57
4	110047	山鹰转债	49,670	4,955,575.90	0.44
5	110046	圆通转债	20,840	2,128,180.80	0.19

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 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。

**8.10.2 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。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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

**8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

**8.12.3 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	1,008,811.91
2	应收证券清算款	6,656,352.68
4	应收利息	2,527,183.75
5	应收申购款	321,687.69
9	合计	10,514,036.03

**8.12.4 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	123006	东财转债	6,316,815.40	0.57
2	127005	长证转债	609,894.00	0.05
3	132012	17 巨化 EB	347,978.70	0.03
4	120001	16 以岭 EB	330,132.00	0.03
5	127003	海印转债	122,916.80	0.01

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300271	华宇软件	14,210,000.00	1.28	大宗流通受限

**8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
61,135	14,180.34	81,830,413.26	9.44%	785,084,959.08	90.56%

### 9.2 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	2,631,612.45	0.3036%

### 9.3 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	>100



**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（ 2006 年 9 月 20 日 ）基金份额总额	3,289,724,684.59
本报告期期初基金份额总额	941,001,756.24
本报告期期间基金总申购份额	216,396,294.42
减:本报告期期间基金总赎回份额	290,482,678.32
本报告期末基金份额总额	866,915,372.34

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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) 报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

- 1) 2018 年 3 月 21 日公告, 自 2018 年 3 月 21 日起, 傅鹏博先生离任公司副总经理。
- 2) 2018 年 5 月 11 日公告, 自 2018 年 5 月 11 日起, 陈锦泉先生担任公司副总经理。
- 3) 2018 年 6 月 13 日公告, 自 2018 年 6 月 12 日起, 杨卫东先生担任公司督察长, 离任公司副总经理; 冯晓莲女士离任公司督察长。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2015 年起连续 4 年聘请德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 5.6 万元人民币。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
中泰证券	2	3,014,892,056.71	31.80%	2,807,769.55	34.38%	-

兴业证券	2	1,826,958,502.54	19.27%	1,336,221.24	16.36%	-
高华证券	1	1,372,726,000.30	14.48%	1,278,416.82	15.65%	-
中信证券	3	1,349,535,391.60	14.23%	958,851.10	11.74%	-
华福证券	1	858,250,238.68	9.05%	799,285.06	9.79%	-
国信证券	1	499,481,533.02	5.27%	465,166.57	5.70%	-
西南证券	1	361,168,048.86	3.81%	336,355.91	4.12%	-
平安证券	1	198,013,825.21	2.09%	184,410.04	2.26%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-

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

### 11.7.2 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
中泰证券	13,068,331.00	11.84%	111,300,000.00	91.76%	-	-
兴业证券	31,644,134.75	28.66%	-	-	-	-

高华证券	11,468,029.44	10.39%	-	-	-	-
中信证券	38,124,160.38	34.53%	-	-	-	-
华福证券	-	-	10,000,000.00	8.24%	-	-
国信证券	1,380,975.52	1.25%	-	-	-	-
西南证券	2,345,454.16	2.12%	-	-	-	-
平安证券	12,371,399.70	11.21%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

兴全基金管理有限公司

2019 年 3 月 28 日