

兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF） 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 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。本中期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 2020 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
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.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 市场中性策略执行情况.....	52
7.13 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57

10.8 其他重大事件.....	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

§ 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	兴证全球基金管理有限公司
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	25,785,058,599.89 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成长带来的资本增值；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。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

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		兴证全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	林兴盛
	联系电话	021-20398888	021-52629999-213707
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	linxingsheng@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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	201204	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	1,045,551,151.10
本期利润	2,851,981,545.07
加权平均基金份额本期利润	0.1152
本期加权平均净值利润率	14.52%
本期基金份额净值增长率	15.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	3,051,899,776.75
期末可供分配基金份额利润	0.1184
期末基金资产净值	21,993,755,614.74
期末基金份额净值	0.8530
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1,895.06%

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	5.40%	0.74%	3.36%	0.44%	2.04%	0.30%
过去三个月	13.33%	0.91%	5.84%	0.45%	7.49%	0.46%
过去六个月	15.80%	1.38%	2.41%	0.73%	13.39%	0.65%
过去一年	29.42%	1.09%	7.50%	0.59%	21.92%	0.50%
过去三年	58.85%	1.14%	15.75%	0.62%	43.10%	0.52%
自基金合同生效起至今	1,895.06%	1.22%	221.47%	0.85%	1,673.59%	0.37%

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：

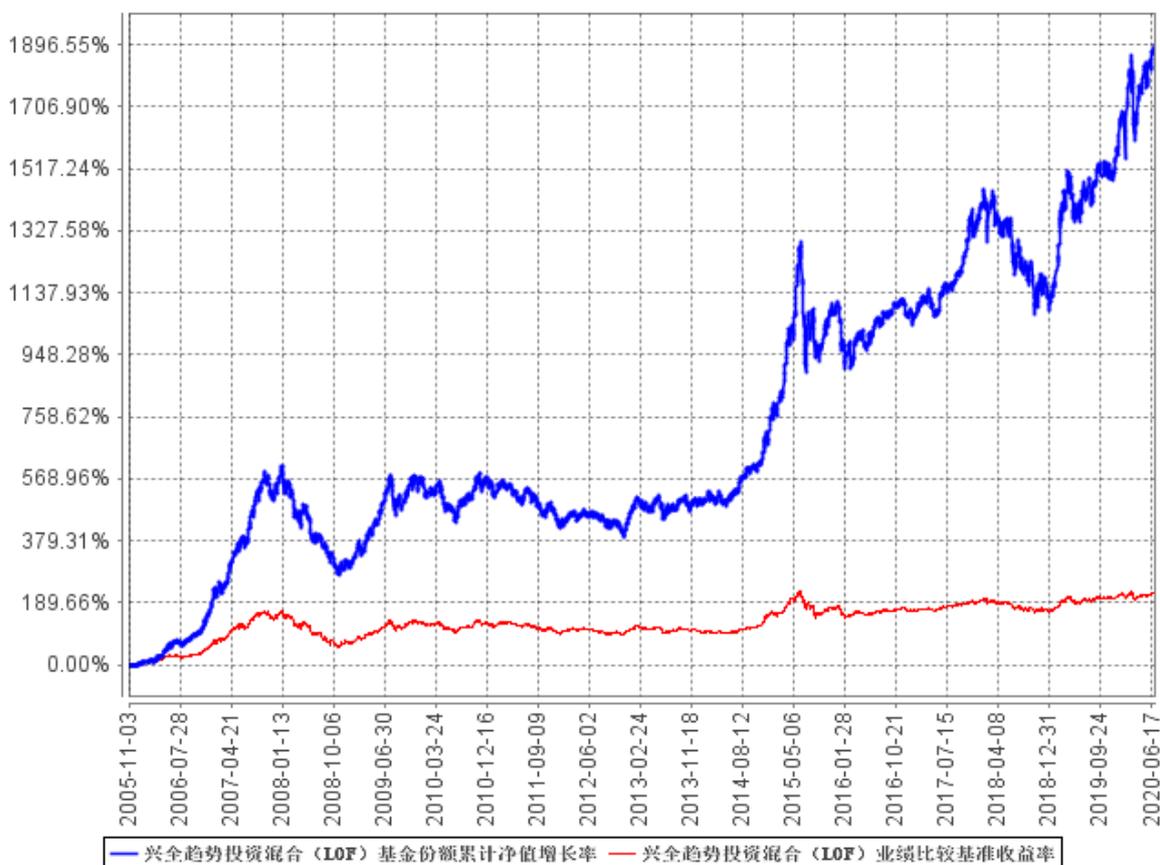
$$\text{Return } t = 50\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{中证国债指数 } t-1 - 1) + 45\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{中证国债指数 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率 } t / 360)$$

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

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 2020 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

兴证全球基金管理有限公司（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”。2020 年 3 月 18 日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截止 2020 年 6 月 30 日，公司旗下已管理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（LOF）、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、兴全恒鑫债券型证券投资基金、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金共 31 只基金。

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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
董承非	副总经理兼研究部总监，本基金、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基金经理	2013 年 10 月 28 日	-	16 年	理学硕士，历任兴证全球基金管理有限公司研究部行业研究员、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）基金经理、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，兴证全球基金管理有限公司基金管理部投资总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。
乔迁	本基金、兴全有机灵活配置混合型证券投资基金基金经理、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理	2017 年 7 月 13 日	-	12 年	工商管理硕士，历任兴证全球基金管理有限公司行业研究员、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理助理。
叶峰	兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理	2020 年 2 月 11 日	-	3 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司研究部研究员。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

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。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体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。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，存在本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超过该证券当日成交量的 5% 的情况，原因为合规调整，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

2020 年上半年 A 股市场整体表现分化明显，受国内外疫情、流动性偏松的影响，市场波动加大，医药、消费、科技等受疫情影响较小的方向超额收益明显，而流动性的宽松又进一步推高了这些板块的整体估值。上证指数上半年表现一般，涨幅为-2.14%，而创业板指表现相对较好，涨幅为 27.94%。行业方面，医药生物、休闲服务、电子、食品饮料、计算机板块在上半年表现相对较好，行业指数涨幅均值超过了 20%，而采掘、银行、非银金融、交通运输、钢铁板块表现较弱，

行业跌幅超过 10%。

本基金在疫情冲击带来的市场回调后积极提升了仓位，但总体持仓结构变化不大，上半年配置的行业大部分受疫情影响相对较小，部分行业甚至受益于疫情的影响，总体来看表现较好。

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 0.8530 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.80%，业绩比较基准收益率为 2.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年突发的疫情成为影响宏观经济的重要因素：国内疫情的爆发和海外疫情的扩散，使得全球经济被冲击，全世界几乎同时为了拯救经济释放了大量的流动性。这次股票市场成为这次流动性释放的最大受益者，无论是国内还是海外市场。目前看，虽然货币政策有边际收敛的迹象，但是股票市场在赚钱效应的惯性推动下，还是表现强势。特别是“核心资产”经过三年左右的估值提升，估值水平提升到前所未有的高度，大部分的公司的业绩增速和估值水平之间匹配程度较差；同时我们也看到，一些行业发展前景一般的价值股虽然拥有吸引人的分红收益率，但是还是吸引不到投资者的关注。A 股市场的分化程度也是达到了历史上比较高的一个程度。这种分化，后续如何演绎，我们也在持续的关注。

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

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 托管人对本中期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中期报告中的财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,412,722,108.66	2,228,328,112.73
结算备付金		4,806,056.85	8,530,586.16
存出保证金		2,723,878.19	2,778,191.81
交易性金融资产	6.4.7.2	19,776,876,193.10	14,899,320,336.87
其中：股票投资		19,776,876,193.10	14,862,342,893.69
基金投资		-	-
债券投资		-	36,977,443.18
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	-	-
应收证券清算款		181,486,863.60	1,263,263.92
应收利息	6.4.7.5	294,593.20	942,945.54
应收股利		-	-
应收申购款		116,879,507.72	35,436,134.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		22,495,789,201.32	17,176,599,571.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		13,990,670.16	2,419,022.26
应付赎回款		450,039,328.80	386,965,968.34
应付管理人报酬		26,985,511.91	21,819,773.90
应付托管费		4,497,585.33	3,636,628.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,678,118.13	5,518,665.83
应交税费		145.87	2,341.64

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,842,226.38	1,036,504.65
负债合计		502,033,586.58	421,398,905.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,456,020,170.10	5,695,603,877.04
未分配利润	6.4.7.10	15,537,735,444.64	11,059,596,788.50
所有者权益合计		21,993,755,614.74	16,755,200,665.54
负债和所有者权益总计		22,495,789,201.32	17,176,599,571.12

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8530 元，基金份额总额 25,785,058,599.89 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,035,607,017.35	3,772,178,947.83
1.利息收入		11,871,897.20	22,437,022.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,372,931.24	18,682,247.28
债券利息收入		44,274.91	3,222,210.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		454,691.05	532,565.43
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,207,182,760.51	617,206,720.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,027,293,658.14	495,144,495.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,960,697.35	1,590,361.56
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	174,928,405.02	120,471,863.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,806,430,393.97	3,128,691,472.61
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	10,121,965.67	3,843,732.03
减：二、费用		183,625,472.28	151,145,929.01

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	146,382,749.94	119,824,551.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,397,125.01	19,970,758.58
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	12,720,524.16	11,199,193.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		159.35	2,533.76
7. 其他费用	6.4.7.20	124,913.82	148,891.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,851,981,545.07	3,621,033,018.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,851,981,545.07	3,621,033,018.82

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	5,695,603,877.04	11,059,596,788.50	16,755,200,665.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,851,981,545.07	2,851,981,545.07
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）	760,416,293.06	1,626,157,111.07	2,386,573,404.13
其中：1.基金申购款	3,504,298,729.23	7,518,499,183.79	11,022,797,913.02
2.基金赎回款	-2,743,882,436.17	-5,892,342,072.72	-8,636,224,508.89
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）	6,456,020,170.10	15,537,735,444.64	21,993,755,614.74

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	5,503,273,808.13	7,480,465,742.35	12,983,739,550.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,621,033,018.82	3,621,033,018.82
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）	568,906,198.10	1,117,917,805.53	1,686,824,003.63
其中：1.基金申购款	1,640,326,839.96	3,147,373,927.22	4,787,700,767.18
2.基金赎回款	-1,071,420,641.86	-2,029,456,121.69	-3,100,876,763.55
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）	6,072,180,006.23	12,219,416,566.70	18,291,596,572.93

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，由兴证全球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证全球基金管理有限公司，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

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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数×50%+中证国债指数×45%+同业存款利率×5%。

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<年度报告和中期报告>》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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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) 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。

(b) 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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以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。对基金在 2018 年 1 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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(c) 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。

(d) 对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司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。

(e) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,412,722,108.66
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,412,722,108.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,790,804,039.89	19,776,876,193.10	3,986,072,153.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	15,790,804,039.89	19,776,876,193.10	3,986,072,153.21

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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

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 2020年6月30日
应收活期存款利息	200,858.99
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	1,946.43
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	90,684.56
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	1,103.22
合计	294,593.20

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	4,678,118.13
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,678,118.13

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,617,800.24
应付证券出借违约金	-
预提费用	224,426.14
其他	-
合计	1,842,226.38

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,747,947,538.42	5,695,603,877.04
本期申购	13,996,019,697.32	3,504,298,729.23
本期赎回(以“-”号填列)	-10,958,908,635.85	-2,743,882,436.17
- 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	25,785,058,599.89	6,456,020,170.10

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	1,751,911,545.71	9,307,685,242.79	11,059,596,788.50
本期利润	1,045,551,151.10	1,806,430,393.97	2,851,981,545.07
本期基金份额交易产生的变动数	254,437,079.94	1,371,720,031.13	1,626,157,111.07
其中：基金申购款	1,257,860,505.44	6,260,638,678.35	7,518,499,183.79
基金赎回款	-1,003,423,425.50	-4,888,918,647.22	-5,892,342,072.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,051,899,776.75	12,485,835,667.89	15,537,735,444.64

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	11,193,496.53
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	65,694.29
其他	113,740.42
合计	11,372,931.24

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	3,951,294,098.17
减：卖出股票成本总额	2,924,000,440.03
买卖股票差价收入	1,027,293,658.14

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 2020年1月1日至2020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	4,960,697.35
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	4,960,697.35

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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	38,148,460.40

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	33,129,900.00
减：应收利息总额	57,863.05
买卖债券差价收入	4,960,697.35

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

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	174,928,405.02
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	174,928,405.02

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	1,806,430,393.97
——股票投资	1,810,910,837.15
——债券投资	-4,480,443.18
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估	-

增值税	
合计	1,806,430,393.97

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	9,933,878.59
转换费收入	188,087.08
合计	10,121,965.67

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	12,720,524.16
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	12,720,524.16

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费用	18,600.00
银行手续费	1,887.68
上市年费	-
其他费用	-
合计	124,913.82

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金以 2020 年 8 月 10 日为权益登记日，对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.820 元进行分红，实际分配收益为人民币 2,163,623,480.49 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
兴证全球基金管理有限公司（以下简称“兴证全球基金”）	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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	1,822,780,231.47	18.67%	2,415,833,624.55	29.94%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	24,171,951.86	63.36%	5,286,471.92	32.64%

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	50,000,000.00	18.25%	43,600,000.00	25.33%

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 2020年1月1日至2020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	1,332,994.50	16.96%	1,011,566.10	21.62%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	1,771,640.84	27.83%	940,006.10	28.20%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券股份有限公司获得证券研究综合服务。

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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	146,382,749.94	119,824,551.86
其中：支付销售机构的客户维护费	28,528,885.51	17,810,131.57

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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,397,125.01	19,970,758.58

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费

率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	14,187,003.41	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,187,003.41	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0550%	-

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。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2020 年 6 月 30 日		2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业银行	289,729,012.22	1.1236%	349,029,012.22	1.5343%

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	2,412,722,108.66	11,193,496.53	3,684,743,191.02	18,549,663.93

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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（2020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
002064	华峰氨纶	2020年2月4日	2021年2月8日	非公开发行流通受限	5.43	4.71	4,465,930	24,249,999.90	21,034,530.30	-
002064	华峰氨纶	2020年2月4日	2022年2月7日	非公开发行流通受限	5.43	4.57	4,465,930	24,249,999.90	20,409,300.10	-
300609	汇纳科技	2020年6月3日	2020年12月7日	非公开发行流通受限	30.61	33.62	50,000	1,530,500.00	1,681,000.00	-
300629	新劲刚	2020年5月22日	2020年11月25日	非公开发行流	17.74	24.71	1,691,093	29,999,989.82	41,786,908.03	-

			日	通受限							
300735	光弘科技	2020年4月23日	2020年10月27日	非公开发行流通受限	23.68	17.36	307,827	7,289,343.36	5,343,876.72	-	
300735	光弘科技	2020年5月29日	2020年10月27日	非公开发行流通受限 - 转增	-	17.36	123,131	-	2,137,554.16	1	
600517	国网英大	2020年5月19日	2020年11月16日	非公开发行流通受限	5.50	6.24	12,727,273	70,000,001.50	79,418,183.52	-	
603955	大千生态	2020年6月9日	2020年12月7日	非公开发行流通受限	13.46	14.64	3,534,857	47,579,175.22	51,750,306.48	-	
002352	顺丰控股	2020年2月5日	2020年8月5日	大宗交易购入流通受限	36.47	53.75	6,970,000	254,195,900.00	374,637,500.00	-	
300124	汇川技术	2020年6月22日	2020年12月22日	大宗交易购入流通受限	32.36	35.61	1,000,000	32,360,000.00	35,610,000.00	-	
688086	紫晶存储	2020年2月19日	2020年8月26日	新股流通受限	21.49	64.54	9,361	201,167.89	604,158.94	-	
688157	松井股份	2020年5月29日	2020年12月9日	新股流通受限	34.48	86.64	3,402	117,300.96	294,749.28	-	
688200	华峰测	2020年2月11日	2020年8月18日	新股流通受限	107.41	270.02	3,780	406,009.80	1,020,675.60	-	

688505	复旦张江	2020年6月10日	2020年12月21日	新股流通受限	8.95	24.78	22,688	203,057.60	562,208.64	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-

注 1、本基金持有的非公开发行股票光弘科技，于 2020 年 5 月 29 日实施 2019 年年度权益分派方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 3.00 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 4 股。本基金新增 123,131.00 股。

注 2、上述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

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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、风险管理部和监察稽核部、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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	24,052,430.88
AAA 以下	-	12,925,012.30
未评级	-	-
合计	-	36,977,443.18

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的同业存单投资。

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

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理

人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	2,412,722,108.66	-	-	-	-	-	2,412,722,108.66
结算备付金	4,806,056.85	-	-	-	-	-	4,806,056.85
存出保证金	2,723,878.19	-	-	-	-	-	2,723,878.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	19,776,876,193.10	19,776,876,193.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	181,486,863.60	181,486,863.60
应收利息	-	-	-	-	-	294,593.20	294,593.20
应收申购款	16,498,987.81	-	-	-	-	100,380,519.91	116,879,507.72
资产总计	2,436,751,031.51	-	-	-	-	20,059,038,169.81	22,495,789,201.32
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	13,990,670.16	13,990,670.16
应付赎回款	-	-	-	-	-	450,039,328.80	450,039,328.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	26,985,511.91	26,985,511.91
应付托管费	-	-	-	-	-	4,497,585.33	4,497,585.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,678,118.13	4,678,118.13
应交税费	-	-	-	-	-	145.87	145.87
其他负债	-	-	-	-	-	1,842,226.38	1,842,226.38
负债总计	-	-	-	-	-	502,033,586.58	502,033,586.58
利率敏感度缺口	2,436,751,031.51	-	-	-	-	19,557,004,583.23	21,993,755,614.74
上年度末 2019 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	2,228,328,112.73	-	-	-	-	-	2,228,328,112.73
结算备付金	8,530,586.16	-	-	-	-	-	8,530,586.16
存出保证金	2,778,191.81	-	-	-	-	-	2,778,191.81
交易性金融资产	-	-	-	12,925,012.30	24,052,430.88	14,862,342,893.69	14,899,320,336.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,263,263.92	1,263,263.92

应收利息	-	-	-	-	942,945.54	942,945.54
应收申购款	3,562,857.28	-	-	-	31,873,276.81	35,436,134.09
资产总计	2,243,199,747.98	-	-12,925,012.30	24,052,430.88	14,896,422,379.96	17,176,599,571.12
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	2,419,022.26	2,419,022.26
应付赎回款	-	-	-	-	386,965,968.34	386,965,968.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	21,819,773.90	21,819,773.90
应付托管费	-	-	-	-	3,636,628.96	3,636,628.96
应付交易费用	-	-	-	-	5,518,665.83	5,518,665.83
应交税金	-	-	-	-	2,341.64	2,341.64
其他负债	-	-	-	-	1,036,504.65	1,036,504.65
负债总计	-	-	-	-	421,398,905.58	421,398,905.58
利率敏感度缺口	2,243,199,747.98	-	-12,925,012.30	24,052,430.88	14,475,023,474.38	16,755,200,665.54

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	利率-1%	-	-
	利率+1%	-	-

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，为交易而持有的债券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

汇率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大汇率风险。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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	19,776,876,193.10	89.92	14,862,342,893.69	88.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	36,977,443.18	0.22
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	19,776,876,193.10	89.92	14,899,320,336.87	88.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 10%	4,103,392,565.45	2,656,614,104.16
业绩比较基准下降 10%	-4,103,392,565.45	-2,656,614,104.16	

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	19,776,876,193.10	87.91
	其中：股票	19,776,876,193.10	87.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,417,528,165.51	10.75
8	其他各项资产	301,384,842.71	1.34
9	合计	22,495,789,201.32	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	7,746,511.00	0.04
B	采矿业	1,575,990,592.00	7.17
C	制造业	8,685,834,499.18	39.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,250,966.44	0.02
E	建筑业	58,471,930.48	0.27
F	批发和零售业	2,629,007,985.48	11.95
G	交通运输、仓储和邮政业	1,234,196,719.60	5.61
H	住宿和餐饮业	19,823,212.50	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	123,723,131.96	0.56
J	金融业	1,522,419,678.46	6.92
K	房地产业	2,007,987,328.28	9.13
L	租赁和商务服务业	128,565,743.91	0.58
M	科学研究和技术服务业	39,016,170.94	0.18
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	747,650,163.47	3.40
R	文化、体育和娱乐业	989,791,791.40	4.50
S	综合	1,399,768.00	0.01
	合计	19,776,876,193.10	89.92

7.2.2 报告期末按行业分类的港股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	601933	永辉超市	219,224,272	2,056,323,671.36	9.35
2	601899	紫金矿业	356,551,940	1,568,828,536.00	7.13
3	601318	中国平安	20,260,899	1,446,628,188.60	6.58
4	600048	保利地产	90,828,685	1,342,447,964.30	6.10
5	600703	三安光电	50,191,596	1,254,789,900.00	5.71
6	002352	顺丰控股	22,512,013	1,224,785,611.10	5.57
7	600031	三一重工	55,426,457	1,039,800,333.32	4.73
8	300144	宋城演艺	54,145,418	936,715,731.40	4.26
9	300054	鼎龙股份	45,133,604	749,217,826.40	3.41
10	002044	美年健康	51,445,067	741,323,415.47	3.37
11	000786	北新建材	31,269,839	666,985,665.87	3.03
12	000002	万科A	25,136,257	657,061,757.98	2.99
13	603883	老百姓	5,586,698	558,893,267.92	2.54
14	600882	妙可蓝多	13,200,547	479,047,850.63	2.18
15	600967	内蒙一机	45,605,992	473,846,256.88	2.15
16	600060	海信视像	35,790,919	434,859,665.85	1.98
17	002415	海康威视	13,598,237	412,706,492.95	1.88
18	300124	汇川技术	10,048,081	379,346,597.19	1.72
19	600760	中航沈飞	10,996,441	360,903,193.62	1.64
20	000938	紫光股份	7,103,900	305,325,622.00	1.39
21	600038	中直股份	7,215,963	296,359,600.41	1.35
22	603833	欧派家居	2,411,802	279,527,851.80	1.27
23	002672	东江环保	29,593,951	266,641,498.51	1.21
24	601100	恒立液压	2,266,796	181,797,039.20	0.83
25	002707	众信旅游	17,386,626	125,183,707.20	0.57

26	600517	国网英大	12,727,273	79,418,183.52	0.36
27	002920	德赛西威	980,608	60,140,688.64	0.27
28	002572	索菲亚	2,400,000	58,008,000.00	0.26
29	601799	星宇股份	428,568	54,428,136.00	0.25
30	300413	芒果超媒	814,050	53,076,060.00	0.24
31	603955	大千生态	3,534,857	51,750,306.48	0.24
32	603589	口子窖	891,729	45,389,006.10	0.21
33	300271	华宇软件	1,492,426	42,101,337.46	0.19
34	300629	新劲刚	1,691,093	41,786,908.03	0.19
35	002064	华峰氨纶	8,931,860	41,443,830.40	0.19
36	603839	安正时尚	3,147,020	39,967,154.00	0.18
37	000710	贝瑞基因	595,501	35,575,229.74	0.16
38	300136	信维通信	609,982	32,341,245.64	0.15
39	601012	隆基股份	776,664	31,633,524.72	0.14
40	002821	凯莱英	121,300	29,475,900.00	0.13
41	603290	斯达半导	132,902	27,882,839.60	0.13
42	002600	领益智造	2,519,100	26,778,033.00	0.12
43	600309	万华化学	511,806	25,585,181.94	0.12
44	600436	片仔癀	140,918	23,991,289.50	0.11
45	002555	三七互娱	476,182	22,285,317.60	0.10
46	300454	深信服	106,000	21,831,760.00	0.10
47	300207	欣旺达	1,149,900	21,733,110.00	0.10
48	002212	南洋股份	798,700	21,229,446.00	0.10
49	002001	新和成	684,878	19,929,949.80	0.09
50	600754	锦江酒店	714,350	19,823,212.50	0.09
51	600036	招商银行	537,520	18,125,174.40	0.08
52	603707	健友股份	275,000	17,756,750.00	0.08
53	002773	康弘药业	339,970	16,862,512.00	0.08
54	600519	贵州茅台	11,000	16,091,680.00	0.07
55	002594	比亚迪	194,100	13,936,380.00	0.06
56	300450	先导智能	251,397	11,617,055.37	0.05
57	000739	普洛药业	492,800	11,477,312.00	0.05
58	300633	开立医疗	287,005	11,379,748.25	0.05
59	002475	立讯精密	218,525	11,221,258.75	0.05
60	000858	五粮液	63,900	10,934,568.00	0.05
61	000661	长春高新	24,534	10,679,650.20	0.05
62	002624	完美世界	180,868	10,425,231.52	0.05
63	600406	国电南瑞	467,233	9,461,468.25	0.04
64	000333	美的集团	151,105	9,034,567.95	0.04

65	000568	泸州老窖	97,300	8,865,976.00	0.04
66	000651	格力电器	153,989	8,711,157.73	0.04
67	000501	鄂武商A	553,900	8,685,152.00	0.04
68	300750	宁德时代	49,100	8,561,076.00	0.04
69	000625	长安汽车	755,113	8,306,243.00	0.04
70	000951	中国重汽	241,630	7,553,353.80	0.03
71	300059	东方财富	371,880	7,511,976.00	0.03
72	300735	光弘科技	430,958	7,481,430.88	0.03
73	300782	卓胜微	16,740	6,792,589.80	0.03
74	600030	中信证券	279,900	6,748,389.00	0.03
75	300433	蓝思科技	228,200	6,398,728.00	0.03
76	300347	泰格医药	62,100	6,326,748.00	0.03
77	603986	兆易创新	26,800	6,322,388.00	0.03
78	600276	恒瑞医药	68,136	6,288,952.80	0.03
79	300709	精研科技	64,510	6,202,636.50	0.03
80	600559	老白干酒	474,300	6,142,185.00	0.03
81	002332	仙琚制药	349,975	5,893,579.00	0.03
82	002271	东方雨虹	144,600	5,875,098.00	0.03
83	002223	鱼跃医疗	155,800	5,671,120.00	0.03
84	300009	安科生物	316,100	5,658,190.00	0.03
85	600600	青岛啤酒	70,000	5,355,000.00	0.02
86	002353	杰瑞股份	168,300	5,217,300.00	0.02
87	002236	大华股份	269,269	5,172,657.49	0.02
88	000338	潍柴动力	372,600	5,112,072.00	0.02
89	000963	华东医药	201,814	5,105,894.20	0.02
90	600779	水井坊	79,900	4,987,358.00	0.02
91	600000	浦发银行	468,200	4,953,556.00	0.02
92	601138	工业富联	323,300	4,897,995.00	0.02
93	600521	华海药业	143,000	4,851,990.00	0.02
94	002460	赣锋锂业	90,000	4,821,300.00	0.02
95	600026	中远海能	720,300	4,653,138.00	0.02
96	600016	民生银行	804,600	4,562,082.00	0.02
97	300498	温氏股份	207,388	4,521,058.40	0.02
98	601668	中国建筑	941,200	4,489,524.00	0.02
99	002146	荣盛发展	547,000	4,430,700.00	0.02
100	600837	海通证券	350,000	4,403,000.00	0.02
101	600900	长江电力	228,698	4,331,540.12	0.02
102	300003	乐普医疗	115,300	4,210,756.00	0.02
103	300408	三环集团	150,000	4,155,000.00	0.02

104	300033	同花顺	30,000	3,992,400.00	0.02
105	603583	捷昌驱动	58,200	3,979,716.00	0.02
106	600352	浙江龙盛	308,200	3,941,878.00	0.02
107	002916	深南电路	23,380	3,916,617.60	0.02
108	002202	金风科技	392,004	3,908,279.88	0.02
109	600346	恒力石化	277,300	3,882,200.00	0.02
110	688030	山石网科	80,000	3,777,600.00	0.02
111	601688	华泰证券	194,400	3,654,720.00	0.02
112	601658	邮储银行	796,578	3,640,361.46	0.02
113	601009	南京银行	495,500	3,632,015.00	0.02
114	002841	视源股份	36,400	3,622,528.00	0.02
115	000977	浪潮信息	92,300	3,616,314.00	0.02
116	603160	汇顶科技	15,700	3,499,530.00	0.02
117	002142	宁波银行	131,200	3,446,624.00	0.02
118	002050	三花智控	156,953	3,437,270.70	0.02
119	002371	北方华创	20,000	3,418,200.00	0.02
120	601872	招商轮船	585,500	3,413,465.00	0.02
121	601888	中国中免	21,957	3,382,036.71	0.02
122	300559	佳发教育	158,638	3,366,298.36	0.02
123	002111	威海广泰	233,100	3,321,675.00	0.02
124	002182	云海金属	348,000	3,319,920.00	0.02
125	300596	利安隆	92,700	3,228,741.00	0.01
126	002540	亚太科技	734,703	3,166,569.93	0.01
127	600887	伊利股份	101,300	3,153,469.00	0.01
128	600426	华鲁恒升	172,204	3,044,566.72	0.01
129	002020	京新药业	272,500	2,913,025.00	0.01
130	002851	麦格米特	111,000	2,877,120.00	0.01
131	600580	卧龙电驱	255,130	2,867,661.20	0.01
132	601229	上海银行	343,080	2,847,564.00	0.01
133	601865	福莱特	150,000	2,820,000.00	0.01
134	002746	仙坛股份	211,300	2,799,725.00	0.01
135	002405	四维图新	166,300	2,742,287.00	0.01
136	002384	东山精密	90,000	2,695,500.00	0.01
137	603338	浙江鼎力	35,358	2,679,075.66	0.01
138	600801	华新水泥	111,200	2,636,552.00	0.01
139	600745	闻泰科技	20,000	2,519,000.00	0.01
140	601601	中国太保	90,600	2,468,850.00	0.01
141	002157	正邦科技	130,400	2,279,392.00	0.01
142	600846	同济科技	262,600	2,232,100.00	0.01

143	600597	光明乳业	150,000	2,229,000.00	0.01
144	601088	中国神华	154,700	2,221,492.00	0.01
145	002035	华帝股份	216,500	2,193,145.00	0.01
146	603816	顾家家居	48,500	2,182,985.00	0.01
147	603259	药明康德	22,400	2,163,840.00	0.01
148	300179	四方达	381,300	2,161,971.00	0.01
149	300760	迈瑞医疗	7,000	2,139,900.00	0.01
150	000718	苏宁环球	681,200	2,104,908.00	0.01
151	002317	众生药业	120,000	2,059,200.00	0.01
152	300571	平治信息	44,400	2,051,280.00	0.01
153	600547	山东黄金	55,000	2,014,100.00	0.01
154	600176	中国巨石	220,000	2,013,000.00	0.01
155	002465	海格通信	133,600	1,728,784.00	0.01
156	300502	新易盛	27,300	1,723,176.00	0.01
157	600588	用友网络	39,000	1,719,900.00	0.01
158	300609	汇纳科技	50,000	1,681,000.00	0.01
159	002563	森马服饰	234,300	1,651,815.00	0.01
160	601398	工商银行	323,800	1,612,524.00	0.01
161	300142	沃森生物	30,000	1,570,800.00	0.01
162	600777	新潮能源	920,900	1,399,768.00	0.01
163	600340	华夏幸福	60,900	1,392,174.00	0.01
164	002273	水晶光电	80,000	1,371,200.00	0.01
165	002120	韵达股份	54,990	1,344,505.50	0.01
166	300725	药石科技	10,800	1,341,900.00	0.01
167	002508	老板电器	42,500	1,322,175.00	0.01
168	601225	陕西煤业	170,400	1,228,584.00	0.01
169	002440	闰土股份	133,700	1,222,018.00	0.01
170	300496	中科创达	14,800	1,149,960.00	0.01
171	300487	蓝晓科技	34,100	1,121,208.00	0.01
172	601238	广汽集团	120,000	1,080,000.00	0.00
173	300631	久吾高科	54,300	1,053,963.00	0.00
174	688200	华峰测控	3,780	1,020,675.60	0.00
175	000001	平安银行	79,000	1,011,200.00	0.00
176	300034	钢研高纳	53,300	999,908.00	0.00
177	601128	常熟银行	131,700	989,067.00	0.00
178	603658	安图生物	6,000	974,640.00	0.00
179	002128	露天煤业	124,300	963,325.00	0.00
180	002812	恩捷股份	14,500	954,100.00	0.00
181	600050	中国联通	194,000	938,960.00	0.00

182	000598	兴蓉环境	197,100	906,660.00	0.00
183	600919	江苏银行	149,500	847,665.00	0.00
184	603489	八方股份	6,000	845,940.00	0.00
185	300699	光威复材	13,300	834,309.00	0.00
186	603043	广州酒家	23,800	773,976.00	0.00
187	601169	北京银行	157,500	771,750.00	0.00
188	603018	中设集团	77,640	755,437.20	0.00
189	600395	盘江股份	137,300	734,555.00	0.00
190	002690	美亚光电	13,800	725,880.00	0.00
191	002832	比音勒芬	38,930	666,481.60	0.00
192	300719	安达维尔	56,300	649,702.00	0.00
193	601966	玲珑轮胎	30,689	619,917.80	0.00
194	688086	紫晶存储	9,361	604,158.94	0.00
195	601288	农业银行	169,400	572,572.00	0.00
196	688505	复旦张江	22,688	562,208.64	0.00
197	601155	新城控股	17,600	549,824.00	0.00
198	300690	双一科技	21,400	535,214.00	0.00
199	300012	华测检测	26,400	521,664.00	0.00
200	300488	恒锋工具	33,900	496,635.00	0.00
201	002458	益生股份	27,880	425,727.60	0.00
202	688157	松井股份	3,402	294,749.28	0.00
203	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
204	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
205	300463	迈克生物	2,200	128,106.00	0.00
206	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
207	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
208	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
209	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
210	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
211	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
212	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
213	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
214	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
215	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
216	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002044	美年健康	622,298,749.48	3.71
2	002415	海康威视	483,753,882.29	2.89
3	600967	内蒙一机	457,806,083.61	2.73
4	600760	中航沈飞	343,753,240.69	2.05
5	601933	永辉超市	332,707,199.59	1.99
6	600703	三安光电	320,676,380.76	1.91
7	600038	中直股份	316,027,483.66	1.89
8	000002	万科A	284,952,855.34	1.70
9	601899	紫金矿业	272,961,137.38	1.63
10	002352	顺丰控股	254,195,900.00	1.52
11	603833	欧派家居	230,372,024.08	1.37
12	300144	宋城演艺	175,110,331.71	1.05
13	600416	*ST 湘电	154,646,699.34	0.92
14	601318	中国平安	147,802,967.42	0.88
15	300124	汇川技术	124,395,753.19	0.74
16	600048	保利地产	73,576,878.67	0.44
17	300450	先导智能	72,239,746.74	0.43
18	600517	国网英大	70,000,001.50	0.42
19	002572	索菲亚	55,008,772.00	0.33
20	002064	华峰氨纶	48,499,999.80	0.29

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	002223	鱼跃医疗	915,668,414.64	5.46
2	601012	隆基股份	589,585,394.82	3.52
3	600416	*ST 湘电	370,867,277.95	2.21
4	601933	永辉超市	231,626,223.22	1.38
5	600584	长电科技	136,901,511.02	0.82

6	603866	桃李面包	127,276,555.64	0.76
7	300450	先导智能	74,228,472.67	0.44
8	600703	三安光电	69,853,434.53	0.42
9	300144	宋城演艺	65,327,185.91	0.39
10	002798	帝欧家居	63,420,985.41	0.38
11	000553	安道麦 A	53,821,920.08	0.32
12	002384	东山精密	36,906,946.92	0.22
13	300792	壹网壹创	31,884,688.58	0.19
14	002115	三维通信	28,438,725.29	0.17
15	002920	德赛西威	26,274,307.00	0.16
16	600882	妙可蓝多	25,875,312.00	0.15
17	600702	舍得酒业	24,924,684.72	0.15
18	600486	扬农化工	24,599,514.51	0.15
19	000651	格力电器	23,884,454.23	0.14
20	600438	通威股份	22,173,772.27	0.13

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	6,027,622,902.29
卖出股票收入（成交）总额	3,951,294,098.17

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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 市场中性策略执行情况

本基金不属于中性策略基金，故此项不适用。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	2,723,878.19
2	应收证券清算款	181,486,863.60
3	应收股利	-
4	应收利息	294,593.20
5	应收申购款	116,879,507.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	301,384,842.71

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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	002352	顺丰控股	374,637,500.00	1.70	大宗交易购入流通受限

7.13.6 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
1,302,240	19,800.54	7,679,957,167.03	29.78%	18,105,101,432.86	70.22%

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	项宇涛	20,122,323.00	1.43%
2	胡艳清	16,325,715.00	1.16%
3	中国太平洋人寿保险股份有 限公司—万能—个人万能	12,189,000.00	0.87%
4	刘一平	11,786,840.00	0.84%
5	华宝基金—招商证券股份有 限公司—华宝基金—宝新六 号单一资产管理计划	11,400,000.00	0.81%
6	关本立	10,243,197.00	0.73%
7	杨巧伟	9,065,072.00	0.65%
8	浙江巴克夏投资管理有限公 司—巴克夏月月利2号私募 基金	8,000,000.00	0.57%
9	浙江巴克夏投资管理有限公 司—巴克夏月月利1号	7,014,589.00	0.50%
10	李家权	6,678,587.00	0.48%

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	55,727,503.02	0.2161%

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研究部门负责人，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	22,747,947,538.42
本报告期基金总申购份额	13,996,019,697.32
减：本报告期基金总赎回份额	10,958,908,635.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	25,785,058,599.89

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无重大人事变动。
 (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	
海通证券	2	3,406,226,688.63	34.89%	3,079,431.52	39.18%	-
中信证券	3	1,951,697,679.09	19.99%	1,232,594.00	15.68%	-
兴业证券	3	1,822,780,231.47	18.67%	1,332,994.50	16.96%	-
中信建投	3	1,172,982,986.27	12.01%	926,880.23	11.79%	-
光大证券	1	856,479,246.90	8.77%	797,605.39	10.15%	-
招商证券	2	259,131,745.06	2.65%	241,325.47	3.07%	-
中金公司	1	208,477,252.30	2.14%	194,158.90	2.47%	-
方正证券	2	85,199,019.74	0.87%	54,779.71	0.70%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

国海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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
海通证券	13,169,960.27	34.52%	154,000,000.00	56.20%	-	-
中信证券	806,548.27	2.11%	-	-	-	-
兴业证券	24,171,951.86	63.36%	50,000,000.00	18.25%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	70,000,000.00	25.55%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
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	关于增加长城证券、民生证券、方正证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 1 月 13 日
2	关于 2020 年春节假期延长至 2 月 2 日暨 2020 年 1 月 31 日相关业务安排的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 1 月 31 日
3	关于使用固有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 2 月 3 日
4	关于旗下部分基金投资华峰氨纶（002064）非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 2 月 6 日
5	关于兴全趋势投资混合基金参加民生银行费率优惠活动的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 2 月 28 日
6	关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下基金基金合同、托管协议的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 2 月 28 日
7	关于公司法定名称变更的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 3 月 19 日
8	关于增加东兴证券、国联证券、华安证券、九州证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 3 月 20 日
9	关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 3 月 26 日
10	关于调整旗下部分基金在招商银行最低定期定额投资金额的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 5 月 12 日
11	关于在东方证券开通旗下部分基金定投业务的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 5 月 21 日
12	关于旗下部分基金投资国网英大（600517）非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 5 月 21 日
13	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 5 月 22 日
14	关于变更直销中心银行账户信息	证券时报、指定互联网网站	2020 年 5 月 25 日

	的公告	网网站	
15	关于旗下部分基金投资新劲刚(300629)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 5 月 26 日
16	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 6 月 2 日
17	关于旗下部分基金投资汇纳科技(300609)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 6 月 5 日
18	关于增加中信证券华南为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 6 月 10 日
19	关于旗下部分基金投资大千生态(603955)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 6 月 11 日
20	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	证券时报、指定互联网网站	2020 年 6 月 19 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。

兴证全球基金管理有限公司

2020年8月31日