

兴全社会责任混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 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.....	12
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.....	13
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.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.3 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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54

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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全社会责任混合型证券投资基金
基金简称	兴全社会责任混合
场内简称	-
基金主代码	340007
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 4 月 30 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,995,998,634.30 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值，同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
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，将定性与定量研究相结合，在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业的基础上，采用“兴全双层行业筛选法”进行优化调整。采用“兴全社会责任四维选股模型”精选股票。
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	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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	田青
	联系电话	021-20398888	010-67595096
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	010 -67595096
传真		021-20398858	010-66275853

注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	201204	100033
法定代表人	兰荣	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴全基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-127,607,506.75
本期利润	1,254,989,265.92
加权平均基金份额本期利润	0.6318
本期加权平均净值利润率	20.98%
本期基金份额净值增长率	24.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	3,394,487,206.96
期末可供分配基金份额利润	1.7006
期末基金资产净值	6,349,673,463.32
期末基金份额净值	3.181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	262.48%

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	5.58%	1.25%	4.42%	0.92%	1.16%	0.33%
过去三个月	-0.31%	1.57%	-0.87%	1.22%	0.56%	0.35%
过去六个月	24.79%	1.54%	21.75%	1.24%	3.04%	0.30%
过去一年	-3.72%	1.65%	8.73%	1.22%	-12.45%	0.43%
过去三年	22.53%	1.40%	19.57%	0.89%	2.96%	0.51%
自基金合同生效起至今	262.48%	1.59%	19.38%	1.32%	243.10%	0.27%

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：

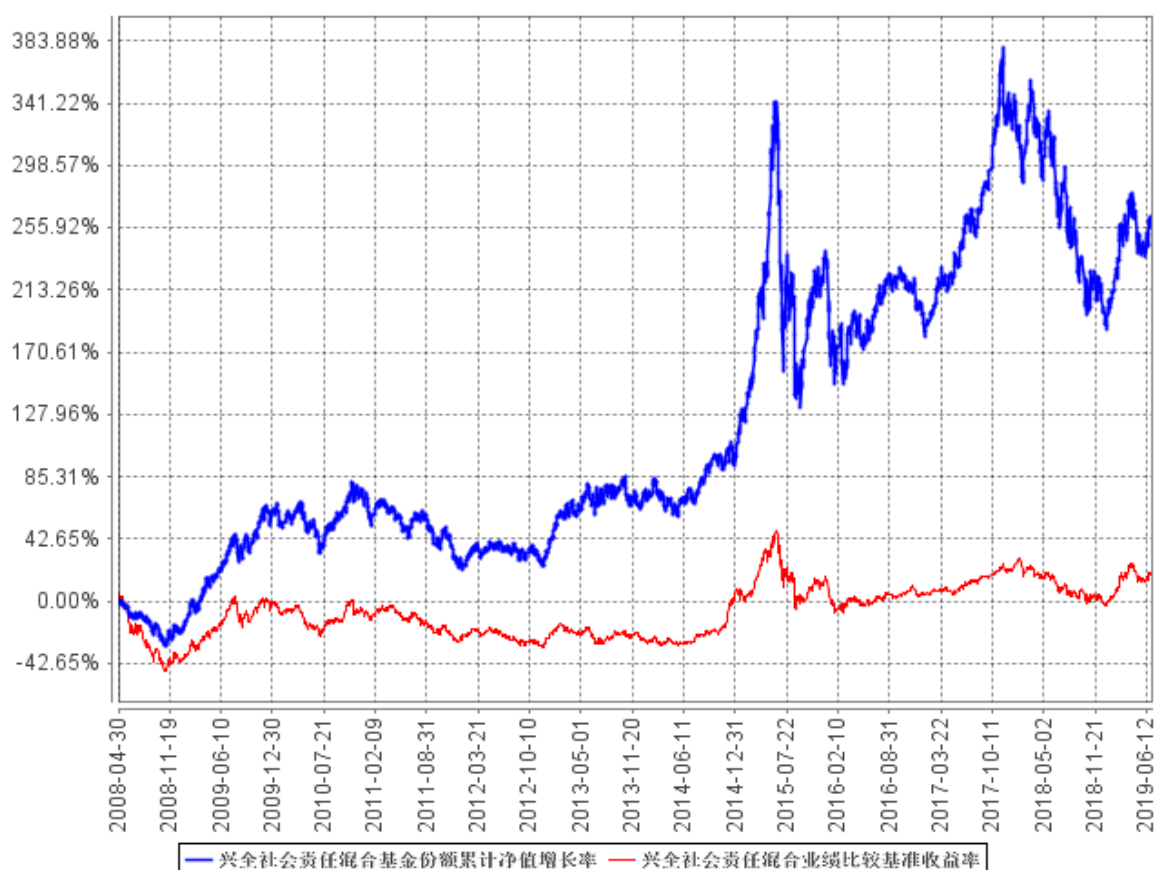
$$\text{Return } t = 80\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{中证国债指数 } t / \text{中证国债指数 } t-1 - 1)$$

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

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

兴全社会责任混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2019 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2008 年 4 月 30 日至 2008 年 10 月 29 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2019年6月30日，公司旗下管理着26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、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（LOF）、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。

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		
季文华	兴全社会责任混合型证券投资基金基	2019年4月2日	-	7年	硕士，历任浙江省化工进出口有限公司医药贸易员，兴业证券股份有限公司研究员，嘉实基金管理

	金经理				有限公司研究员、基金经理。
董理	本基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理	2017 年 12 月 25 日	2019 年 4 月 2 日	11 年	数学博士，历任国信智能技术有限公司技术部系统工程师，嘉实基金管理有限公司分析师、基金经理，华夏久盈资产管理有限公司投资经理。
董承非	副总经理兼研究部总监、本基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF)、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	2018 年 6 月 22 日	2019 年 6 月 27 日	15 年	理学硕士，历任兴全基金管理有限公司研究策划部行业研究员、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，兴全基金管理有限公司基金管理部投资总监。

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

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

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司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，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

随着宏观经济的逐季回落，以及贸易战风险的再次加剧，二季度市场呈现阶段性见顶回落的态势。一方面，今年一季度经济基本面较好，二季度边际上有所收紧；另一方面，贸易战的不确定性影响了市场的风险偏好，尤其是对科技股的担心也使得板块出现较大幅度的调整。不过我们认为，今年经济的逐渐寻底已经在市场价格中得到了充分体现，外部环境错综复杂，但并未根本性改变经济的趋势，因此我们依然保持较高的仓位运行。

结构上，我们提高了依靠内需的消费类股票的配置比例，重仓的行业有医药、食品饮料和家电。降低了受贸易战影响较大的细分行业的持仓比例，如电子、计算机等。但是基于对科技类产业远期良好的成长前景，我们依然保留了部分竞争力优势明显的股票持仓。

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 3.181 元；本报告期基金份额净值增长率为 24.79%，业绩比较基准收益率为 21.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年以来，全球经济有逐渐放缓的迹象，美联储也有望开启降息通道，货币宽松将是一个大的背景，资金加速流向新兴市场；上半年中国经济保持了快速增长，良好的基本面符合市场预期，因此 A 股也迎来小阳春。但我们也注意到，市场依然形成高度分化的局面，拥有良好基本面的优质公司继续保持了优异的表现，持续大幅跑赢行业基准。

伴随着海外投资者不断增持中国的核心资产，A 股也越来越国际化、机构化，这对于管理人

也提出了更高的要求，如国际化的视野，系统专业的分析体系，甄别长期优质企业的核心能力等。在深刻认识到具备国际化的投资理念与建立正确的投资哲学和逻辑的重要性之外，我们还需要将这些观念落实到实际工作中，建立完备的投资分析流程与体系，涵盖包括产业、企业、财务和估值等各维度的分析。此外我们还需要把重心放在具有长期增长前景的战略性资产上，立足于中长期投资，做时间的朋友。

展望下半年，我们综合判断经济整体仍保持在平稳向下的轨道中，呈现温和走低的态势。打破刚兑后信用利差会持续扩大，金融供给侧改革正式开启。对于实体经济而言，马太效应使得各行业加剧分化，拥有核心竞争力的龙头企业最终可能会受益于行业集中度的提升。对于投资而言，我们更需要把资源投向优秀的企业，和他们共同成长。

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》、《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本半年度报告中的财务指标、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。

§ 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：兴全社会责任混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	658,772,957.80	1,085,304,512.57
结算备付金		6,407,724.03	-
存出保证金		2,382,180.52	701,856.59
交易性金融资产	6.4.7.2	5,729,036,384.31	3,771,247,157.06
其中：股票投资		5,707,980,174.79	3,674,681,126.56
基金投资		-	-
债券投资		21,056,209.52	96,566,030.50
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	150,848.44	2,352,044.89
应收股利		-	-
应收申购款		2,717,700.12	5,284,391.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		6,399,467,795.22	4,864,889,962.83
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		22,259,214.75	20,585,551.04
应付赎回款		14,621,166.04	6,668,509.23
应付管理人报酬		7,571,106.55	6,478,780.46
应付托管费		1,261,851.10	1,079,796.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,920,741.07	2,343,978.11
应交税费		86.29	71.54

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	160,166.10	396,483.64
负债合计		49,794,331.90	37,553,170.79
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,995,998,634.30	1,893,719,116.24
未分配利润	6.4.7.10	4,353,674,829.02	2,933,617,675.80
所有者权益合计		6,349,673,463.32	4,827,336,792.04
负债和所有者权益总计		6,399,467,795.22	4,864,889,962.83

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.181 元，基金份额总额 1,995,998,634.30 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全社会责任混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		1,326,271,828.84	-860,775,118.74
1.利息收入		2,462,163.84	7,208,369.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,057,951.01	782,676.39
债券利息收入		404,212.83	6,425,692.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-60,274,704.16	691,851,642.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-97,124,063.67	644,869,722.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,259,996.72	-71,720.00
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	35,589,362.79	47,053,640.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,382,596,772.67	-1,562,160,955.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,487,596.49	2,325,824.48
减：二、费用		71,282,562.92	71,780,446.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	44,325,792.08	55,228,531.89

2. 托管费	6.4.10.2.2	7,387,632.02	9,204,755.26
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	19,409,876.18	7,131,630.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		39.19	6.69
7. 其他费用	6.4.7.20	159,223.45	215,521.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,254,989,265.92	-932,555,565.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,254,989,265.92	-932,555,565.28

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全社会责任混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,893,719,116.24	2,933,617,675.80	4,827,336,792.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,254,989,265.92	1,254,989,265.92
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）	102,279,518.06	165,067,887.30	267,347,405.36
其中：1.基金申购款	580,478,759.64	1,169,806,490.17	1,750,285,249.81
2.基金赎回款	-478,199,241.58	-1,004,738,602.87	-1,482,937,844.45
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）	1,995,998,634.30	4,353,674,829.02	6,349,673,463.32

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	2,285,684,691.17	6,346,088,270.51	8,631,772,961.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-932,555,565.28	-932,555,565.28
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)	-396,139,112.17	-1,059,881,082.45	-1,456,020,194.62
其中：1.基金申购款	477,060,077.25	1,296,398,606.94	1,773,458,684.19
2.基金赎回款	-873,199,189.42	-2,356,279,689.39	-3,229,478,878.81
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)	1,889,545,579.00	4,353,651,622.78	6,243,197,201.78

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

兴全社会责任混合型证券投资基金(原名“兴业社会责任股票型证券投资基金”)(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”)《关于核准兴业社会责任股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]356号文)的核准,由兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2008年4月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为1,388,696,479.84份基金份额。根据《兴全基金管理有限公司关于旗下部分基金更名的公告》,自2015年8月7日起,“兴全社会责任股票型证券投资基金”更名为“兴全社会责任混合型证券投资基金”。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银

行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》和《兴全社会责任混合型证券投资基金招募说明书(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的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券及其他中国证监会批准的投资工具。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 65%-95%; 债券资产 0%-30%; 资产支持证券占 0%-20%; 权证投资比例 0%-3%; 现金或者到期日在一年内的政府债券不小于基金资产净值的 5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为: $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证国债指数}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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 [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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(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）运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	658,772,957.80
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：	658,772,957.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,788,795,784.65	5,707,980,174.79	919,184,390.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,056,209.52	2,367,109.52
	银行间市场	-	-
	合计	21,056,209.52	2,367,109.52
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,807,484,884.65	5,729,036,384.31	921,551,499.66

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	129,574.07
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	2,883.50
应收债券利息	17,318.97
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,071.90
合计	150,848.44

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,920,741.07
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,920,741.07

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	30,805.32
预提审计费用	44,630.98
预提信息披露费	84,729.80
合计	160,166.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,893,719,116.24	1,893,719,116.24
本期申购	580,478,759.64	580,478,759.64
本期赎回(以“-”号填列)	-478,199,241.58	-478,199,241.58
- 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	1,995,998,634.30	1,995,998,634.30

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,366,763,069.30	-433,145,393.50	2,933,617,675.80
本期利润	-127,607,506.75	1,382,596,772.67	1,254,989,265.92
本期基金份额交易产生的变动数	155,331,644.41	9,736,242.89	165,067,887.30
其中：基金申购款	953,280,978.16	216,525,512.01	1,169,806,490.17
基金赎回款	-797,949,333.75	-206,789,269.12	-1,004,738,602.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,394,487,206.96	959,187,622.06	4,353,674,829.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	1,891,671.21
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	121,602.16
其他	44,677.64
合计	2,057,951.01

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	7,051,020,273.25
减：卖出股票成本总额	7,148,144,336.92
买卖股票差价收入	-97,124,063.67

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 2019年1月1日至2019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	1,259,996.72
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	1,259,996.72

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	93,685,714.07

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	89,936,600.00
减：应收利息总额	2,489,117.35
买卖债券差价收入	1,259,996.72

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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	35,589,362.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	35,589,362.79

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	1,382,596,772.67
——股票投资	1,381,450,093.65
——债券投资	1,146,679.02
——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	1,382,596,772.67
----	------------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	1,442,849.39
转换费收入	44,747.10
合计	1,487,596.49

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	19,409,876.18
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	19,409,876.18

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	84,729.80
账户维护费用	18,000.00
其他	600.00
银行费用	11,262.67
合计	159,223.45

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，注册登记机构，基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	5,895,063,995.97	39.70%	100,228,448.32	1.97%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	1,199,100.00	50.03%	2,880,200.00	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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 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	4,313,173.96	39.04%	814,416.41	20.77%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	73,804.22	2.28%	47,906.22	6.85%

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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	44,325,792.08
其中：支付销售机构的客户维护费	9,312,549.64	11,313,311.19

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	7,387,632.02		9,204,755.26	

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内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间基金管理人均无运用固有资金投资本基金的情况。

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和上年度末均未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
建设银行	658,772,957.80	1,891,671.21	637,529,234.50	733,365.68

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
603866	桃李面包	2019年1月9日	2019年7月9日	大宗交易购入流通受限	42.23	41.34	2,000,000	84,460,000.00	82,680,000.00	-
603866	桃李面包	2019年4月25日	2019年7月9日	大宗交易购入流通受限-转增	-	41.34	800,000	-	33,072,000.00	注1
002773	康弘药业	2019年2月12日	2019年8月12日	大宗交易购入流通受限	36.10	31.95	221,000	7,978,100.00	7,060,950.00	-
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年8月12日	大宗交易购入流通受限-转增	-	31.95	66,300	-	2,118,285.00	注2
002773	康弘药业	2019年2月15日	2019年8月15日	大宗交易购入流通受限	36.65	31.86	1,450,000	53,142,500.00	46,197,000.00	-

002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年8月15日	大宗交易购入流通受限转增	-	31.86	435,000	-	13,859,100.00	注2
002773	康弘药业	2019年3月1日	2019年9月2日	大宗交易购入流通受限	36.74	31.37	1,300,000	47,762,000.00	40,781,000.00	-
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年9月2日	大宗交易购入流通受限转增	-	31.37	390,000	-	12,234,300.00	注2
002773	康弘药业	2019年3月4日	2019年9月4日	大宗交易购入流通受限	36.80	31.34	350,000	12,880,000.00	10,969,000.00	-
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年9月4日	大宗交易购入流通受限转增	-	31.34	105,000	-	3,290,700.00	注2
002773	康弘药业	2019年3月12日	2019年9月12日	大宗交易购入流通受限	40.95	31.23	850,000	34,807,500.00	26,545,500.00	-
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年9月12日	大宗交易购入流通受限转增	-	31.23	255,000	-	7,963,650.00	注2
300699	光威复材	2019年5月7日	2019年11月7日	大宗交易购入流通受限	48.90	30.47	1,840,000	89,976,000.00	56,064,800.00	-

300699	光威复材	2019年5月16日	2019年11月7日	大宗交易购入流通受限-转增	-	30.47	736,000	-	22,425,920.00	注3
--------	------	------------	------------	---------------	---	-------	---------	---	---------------	----

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113537	文灿转债	2019年6月12日	2019年7月5日	新债流通受限	100.00	100.00	7,420	742,000.00	742,000.00	-
123027	蓝晓转债	2019年6月13日	2019年7月4日	新债流通受限	100.00	100.00	670	67,000.00	67,000.00	-
113027	华钰转债	2019年6月18日	2019年7月10日	新债流通受限	100.00	100.00	4,120	412,000.00	412,000.00	-
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	新债流通受限	100.00	100.00	3,060	306,000.00	306,000.00	-
123028	清水转债	2019年6月21日	2019年7月15日	新债流通受限	100.00	100.00	3,430	343,000.00	343,000.00	-
128069	华森转债	2019年6月26日	2019年7月11日	新债流通受限	100.00	100.00	560	56,000.00	56,000.00	-

注1：本基金持有的大宗交易购入股票桃李面包，于2019年4月25日实施2018年年度权益分配方案，向全体股东每股派发现金股利人民币1.00元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每股转增0.40股。本基金新增800,000股。

2：本基金持有的大宗交易购入股票康弘药业，于2019年6月6日实施2018年年度权益分配方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币2.80元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增3股。本基金新增1,251,300股。

3：本基金持有的大宗交易购入股票光威复材，于2019年5月16日实施2018年年度权益分配方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币5.00元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增4股。本基金新增736,000股。

4：上述流通受限证券可流通日系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等流通受限股票。

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险管理委员会，实施董事会风险控制委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面，风险管理部和监察稽核部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，为业务部门的风险管理系统的发展提供协助；各业务部门是风险管理的第一线，风险管理时业务部门的最首要责任。

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、相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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；本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并采用券款对付交割方式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

本基金于本年度末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本年度末及上年度末均未持有短期信用资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本年度末及上年度末均未持有短期信用同业存单投资。

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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	103,074,850.90	-
AAA 以下	13,014,984.32	6,563,030.50
未评级	0.00	-
合计	116,089,835.22	6,563,030.50

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本年度末及上年度末均未持有长期信用资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本年度末及上年度末均未持有短期信用同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。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，除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，其余金融资产均能及时变现。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有人的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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，并按照合约规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 2019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	658,772,957.80	-	-	-	-	-	658,772,957.80
结算备付金	6,407,724.03	-	-	-	-	-	6,407,724.03
存出保证金	2,382,180.52	-	-	-	-	-	2,382,180.52
交易性金融资产	-	-	-	-	21,056,209.52	5,707,980,174.79	5,729,036,384.31
应收利息	-	-	-	-	-	150,848.44	150,848.44
应收申购款	60,816.22	-	-	-	-	2,656,883.90	2,717,700.12

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	667,623,678.57	-	-	-	-21,056,209.52	5,710,787,907.13	6,399,467,795.22
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	22,259,214.75	22,259,214.75
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,621,166.04	14,621,166.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,571,106.55	7,571,106.55
应付托管费	-	-	-	-	-	1,261,851.10	1,261,851.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,920,741.07	3,920,741.07
应交税费	-	-	-	-	-	86.29	86.29
其他负债	-	-	-	-	-	160,166.10	160,166.10
负债总计	-	-	-	-	-	49,794,331.90	49,794,331.90
利率敏感度缺口	667,623,678.57	-	-	-	-21,056,209.52	5,660,993,575.23	6,349,673,463.32
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,085,304,512.57	-	-	-	-	-	1,085,304,512.57
存出保证金	701,856.59	-	-	-	-	-	701,856.59
交易性金融资产	-90,003,000.00	-	-	-	6,563,030.50	3,674,681,126.56	3,771,247,157.06
应收利息	-	-	-	-	-	2,352,044.89	2,352,044.89
应收申购款	146,824.82	-	-	-	-	5,137,566.90	5,284,391.72
资产总计	1,086,153,193.98	90,003,000.00	-	-	6,563,030.50	3,682,170,738.35	4,864,889,962.83
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	20,585,551.04	20,585,551.04
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,668,509.23	6,668,509.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	6,478,780.46	6,478,780.46
应付托管费	-	-	-	-	-	1,079,796.77	1,079,796.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,343,978.11	2,343,978.11
应交税费	-	-	-	-	-	71.54	71.54

其他负债	-	-	-	-	396,483.64	396,483.64
负债总计	-	-	-	-	37,553,170.79	37,553,170.79
利率敏感度缺口	1,086,153,193.98	90,003,000.00	-	6,563,030.50	3,644,617,567.56	4,827,336,792.04

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	市场利率下降 1%	-	142,659.72
	市场利率上升 1%	-	-142,206.52

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 2019年6月30日		上年度末 2018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	5,707,980,174.79	89.89	3,674,681,126.56	76.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	21,056,209.52	0.33	96,566,030.50	2.00
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	5,729,036,384.31	90.23	3,771,247,157.06	78.12

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的股票指数以外的其他市场变量保持不变		
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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准上升 10%	691,131,968.18	547,540,641.94
业绩比较基准上升 10%	-691,131,968.18	-547,540,641.94	

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	5,707,980,174.79	89.19
	其中：股票	5,707,980,174.79	89.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,056,209.52	0.33
	其中：债券	21,056,209.52	0.33
	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	665,180,681.83	10.39
8	其他各项资产	5,250,729.08	0.08
9	合计	6,399,467,795.22	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	363,431.25	0.01
C	制造业	3,402,603,139.43	53.59
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	141,994,635.68	2.24
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	39,603.76	0.00
J	金融业	1,358,340,384.08	21.39
K	房地产业	263,168,588.52	4.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	541,447,285.47	8.53
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,707,980,174.79	89.89

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	601318	中国平安	6,726,374	596,024,000.14	9.39
2	600763	通策医疗	6,111,833	541,447,285.47	8.53
3	600036	招商银行	14,841,640	534,002,207.20	8.41
4	000651	格力电器	9,387,984	516,339,120.00	8.13
5	600887	伊利股份	11,189,239	373,832,474.99	5.89
6	002032	苏泊尔	4,409,898	334,402,565.34	5.27
7	002773	康弘药业	10,301,782	331,652,032.44	5.22
8	600031	三一重工	20,573,258	269,098,214.64	4.24
9	000002	万科A	9,463,092	263,168,588.52	4.14
10	300760	迈瑞医疗	1,558,751	254,388,163.20	4.01
11	000001	平安银行	16,566,060	228,280,306.80	3.60
12	600276	恒瑞医药	3,182,689	210,057,474.00	3.31
13	600741	华域汽车	9,050,961	195,500,757.60	3.08
14	601799	星宇股份	2,159,766	170,535,123.36	2.69
15	002475	立讯精密	6,324,365	156,781,008.35	2.47
16	603866	桃李面包	3,693,899	152,982,893.35	2.41
17	002415	海康威视	5,390,839	148,679,339.62	2.34
18	601933	永辉超市	13,907,408	141,994,635.68	2.24
19	002938	鹏鼎控股	4,210,404	123,617,461.44	1.95
20	300699	光威复材	2,878,533	88,383,549.10	1.39
21	600211	西藏药业	2,405,192	76,148,378.72	1.20
22	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
23	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
24	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
25	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00

26	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
27	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
28	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.00
29	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
30	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	000651	格力电器	505,369,221.91	10.47
2	600036	招商银行	479,885,923.55	9.94
3	600887	伊利股份	374,482,187.15	7.76
4	002773	康弘药业	368,431,017.43	7.63
5	601688	华泰证券	366,309,940.11	7.59
6	600031	三一重工	319,217,074.70	6.61
7	600276	恒瑞医药	317,454,737.46	6.58
8	600763	通策医疗	287,473,660.14	5.96
9	002415	海康威视	280,900,205.14	5.82
10	600271	航天信息	265,927,287.96	5.51
11	002925	盈趣科技	231,313,280.44	4.79
12	000001	平安银行	229,464,411.38	4.75
13	300760	迈瑞医疗	225,630,431.31	4.67
14	600741	华域汽车	209,356,341.55	4.34
15	300699	光威复材	206,150,843.24	4.27
16	300750	宁德时代	191,794,257.08	3.97
17	000963	华东医药	168,434,733.24	3.49
18	601799	星宇股份	153,583,969.57	3.18
19	600570	恒生电子	151,317,075.73	3.13
20	002032	苏泊尔	151,061,255.95	3.13
21	601933	永辉超市	139,949,805.13	2.90
22	002179	中航光电	137,590,238.74	2.85
23	603986	兆易创新	130,200,161.73	2.70
24	600873	梅花生物	129,123,906.57	2.67

25	603866	桃李面包	124,891,797.64	2.59
26	300059	东方财富	123,293,876.88	2.55
27	601607	上海医药	115,610,840.96	2.39
28	600211	西藏药业	113,872,588.33	2.36
29	000550	江铃汽车	112,566,907.90	2.33
30	000002	万科A	101,460,460.88	2.10

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	601012	隆基股份	536,573,152.75	11.12
2	002271	东方雨虹	491,983,153.37	10.19
3	600271	航天信息	475,625,714.37	9.85
4	601688	华泰证券	381,513,281.79	7.90
5	002415	海康威视	351,388,540.43	7.28
6	002475	立讯精密	319,406,248.00	6.62
7	002142	宁波银行	305,145,896.49	6.32
8	600703	三安光电	302,335,379.16	6.26
9	002179	中航光电	268,386,138.03	5.56
10	600887	伊利股份	208,493,460.24	4.32
11	300750	宁德时代	190,387,588.50	3.94
12	002925	盈趣科技	186,683,345.51	3.87
13	600036	招商银行	163,849,746.34	3.39
14	000550	江铃汽车	158,554,149.29	3.28
15	600570	恒生电子	157,336,614.32	3.26
16	603885	吉祥航空	147,099,581.21	3.05
17	000963	华东医药	141,587,059.37	2.93
18	600867	通化东宝	138,071,434.92	2.86
19	000681	视觉中国	137,336,840.13	2.84
20	600276	恒瑞医药	120,941,328.44	2.51
21	600873	梅花生物	118,866,305.35	2.46
22	300059	东方财富	112,954,524.54	2.34
23	603986	兆易创新	112,510,896.94	2.33
24	002044	美年健康	110,610,618.38	2.29
25	601398	工商银行	104,110,091.86	2.16
26	300699	光威复材	103,113,154.88	2.14

27	601607	上海医药	101,747,474.25	2.11
28	000651	格力电器	98,400,228.34	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。

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	7,799,993,291.50
卖出股票收入（成交）总额	7,051,020,273.25

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	21,056,209.52	0.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,056,209.52	0.33

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	113020	桐昆转债	65,650	7,800,533.00	0.12
2	127010	平银转债	39,320	4,683,405.20	0.07
3	123025	精测转债	11,991	1,354,023.72	0.02
4	110053	苏银转债	11,690	1,246,738.50	0.02
5	113021	中信转债	11,170	1,161,009.80	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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。

7.12.2 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。

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	2,382,180.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	150,848.44
5	应收申购款	2,717,700.12
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,250,729.08

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	113020	桐昆转债	7,800,533.00	0.12

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002773	康弘药业	171,019,485.00	2.69	大宗交易购入流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,019,328	1,958.15	306,987,992.40	15.38%	1,689,010,641.90	84.62%

8.2 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	2,953,664.74	0.1480%

8.3 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年4月30日）基金份额总额	1,388,696,479.84
本报告期期初基金份额总额	1,893,719,116.24
本报告期期间基金总申购份额	580,478,759.64
减：本报告期期间基金总赎回份额	478,199,241.58
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,995,998,634.30

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。

2019 年 4 月 12 日公告，自 2019 年 4 月 12 日起，詹鸿飞先生担任公司副总经理暨首席信息官，严长胜先生担任公司副总经理。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

托管人建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管部业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	5,895,063,995.97	39.70%	4,313,173.96	39.04%	-
西部证券	2	2,329,341,387.90	15.69%	1,470,514.02	13.31%	-
华泰证券	2	1,675,226,569.48	11.28%	1,560,141.35	14.12%	-
申万宏源	2	882,781,152.54	5.95%	769,537.87	6.97%	-
银河证券	1	815,935,616.32	5.49%	759,876.07	6.88%	-
海通证券	1	613,758,427.39	4.13%	387,462.15	3.51%	-

中金公司	1	590,220,743.05	3.97%	372,606.75	3.37%	-
国都证券	2	540,652,449.13	3.64%	341,316.36	3.09%	-
东方证券	1	493,462,535.02	3.32%	360,869.79	3.27%	-
西藏东方财富	2	248,697,561.91	1.67%	107,267.86	0.97%	-
中信建投	2	248,686,683.46	1.67%	156,995.67	1.42%	-
国泰君安	1	225,263,646.55	1.52%	209,787.07	1.90%	-
长江证券	1	134,365,889.56	0.90%	125,134.46	1.13%	-
中泰证券	1	104,067,447.20	0.70%	65,697.70	0.59%	-
德邦证券	1	51,401,589.88	0.35%	47,870.97	0.43%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	1,199,100.00	50.03%	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	388,854.07	16.22%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	808,860.00	33.75%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-

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	旗下各基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 1 日
2	关于调整部分旗下基金在国元证券费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 1 月 14 日
3	关于长期停牌股票（长春高新）估值方法调整的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 2 月 27 日
4	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定投费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 3 月 29 日
5	关于兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 2 日
6	关于长期停牌股票（格力电器）估值方法调整的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 3 日
7	关于调整部分旗下基金在爱建证券费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 8 日
8	关于增聘副总经理的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 12 日
9	关于长期停牌股票（隆基股份）估值方法调整的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 4 月 13 日

10	关于增加兴证期货公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 21 日
11	关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 22 日
12	关于调整旗下部分基金参加中国银行定投费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 27 日
13	关于旗下基金所持证券（中科曙光）调整估值价的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 27 日
14	关于调整网上直销基金转换、赎回转购优惠费率率的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 年 6 月 27 日
15	关于兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理变更的公告	上海证券报、基金管理人网站	2019 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
-	-	-	-	-	-	-	-
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、《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全社会责任混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全社会责任混合型证券投资基金招募说明书》
- 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

2019年8月24日