

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (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：中国农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。

基金托管人中国农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	7
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	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
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	14
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	15
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	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 市场中性策略执行情况	60
7.13 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	65
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67

10.8 其他重大事件.....	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
§12 备查文件目录.....	71
12.1 备查文件目录.....	71
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	兴全沪深 300 指数（LOF）	
场内简称	兴全 300	
基金主代码	163407	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2010 年 11 月 2 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,261,657,549.01 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	2011 年 1 月 19 日	
下属分级基金的基金简称:	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C
下属分级基金场内简称:	兴全 300	无
下属分级基金的交易代码:	163407	007230
下属分级基金的前端交易代码	163407	
下属分级基金的后端交易代码	163408	
报告期末下属分级基金的份额总额	2,212,030,034.37 份	49,627,514.64 份

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。	
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。	
业绩比较基准	沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。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。	
	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C
下属分级基金	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收	本基金属于股票型基金，预

的风险收益特征	益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。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。	期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。
---------	---	---

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	贺倩
	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95599
传真		021-20398858	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京东城区建国门内大街 69 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	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		201204	100031
法定代表人		兰荣	周慕冰

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	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号
	C 类份额：兴证全球基金管理有限公司	C 类份额：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

基金级别	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C
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)	报告期(2020 年 1 月 1 日 – 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	140,120,835.29	2,846,040.86
本期利润	167,016,048.76	4,726,696.50
加权平均基金份额本期利润	0.0649	0.0748
本期加权平均净值利润率	3.18%	3.67%
本期基金份额净值增长率	2.42%	2.22%
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	2,284,808,042.87	46,659,042.68
期末可供分配基金份额利润	1.0329	0.9402
期末基金资产净值	4,817,367,859.02	107,862,301.30
期末基金份额净值	2.1778	2.1734
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	117.78%	18.62%

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

兴全沪深 300 指数（LOF）A

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	8.62%	0.81%	7.29%	0.85%	1.33%	-0.04%
过去三个月	14.20%	0.87%	12.29%	0.85%	1.91%	0.02%
过去六个月	2.42%	1.44%	1.64%	1.45%	0.78%	-0.01%
过去一年	11.79%	1.15%	8.51%	1.16%	3.28%	-0.01%
过去三年	34.55%	1.18%	13.27%	1.19%	21.28%	-0.01%

自基金合同 生效起至今	117.78%	1.36%	20.66%	1.37%	97.12%	-0.01%
----------------	---------	-------	--------	-------	--------	--------

兴全沪深 300 指数 C

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	8.58%	0.81%	7.29%	0.85%	1.29%	-0.04%
过去三个月	14.08%	0.86%	12.29%	0.85%	1.79%	0.01%
过去六个月	2.22%	1.44%	1.64%	1.45%	0.58%	-0.01%
过去一年	11.58%	1.25%	8.53%	1.27%	3.05%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	18.62%	1.24%	15.04%	1.26%	3.58%	-0.02%

注：1、本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是沪深 300 指数，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：

$$\text{Return } t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率 } t / 360)$$

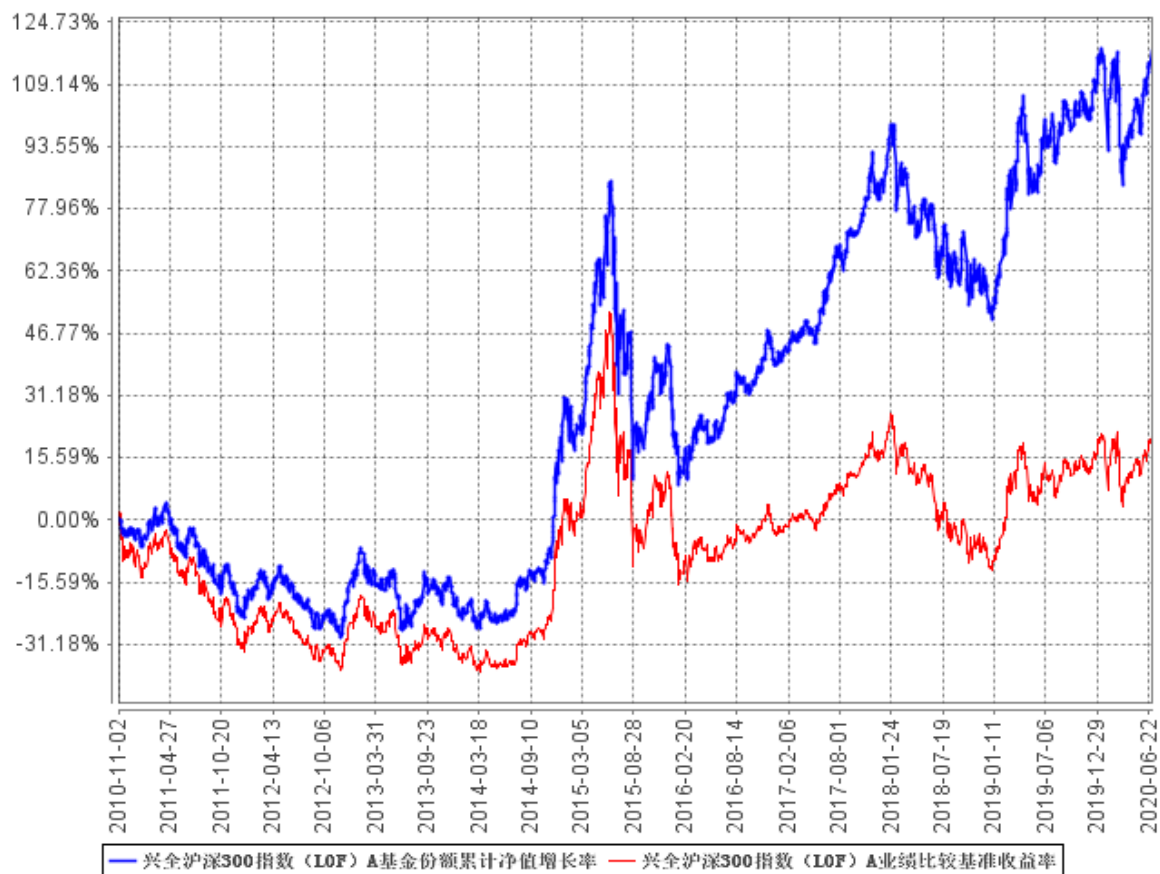
$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

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

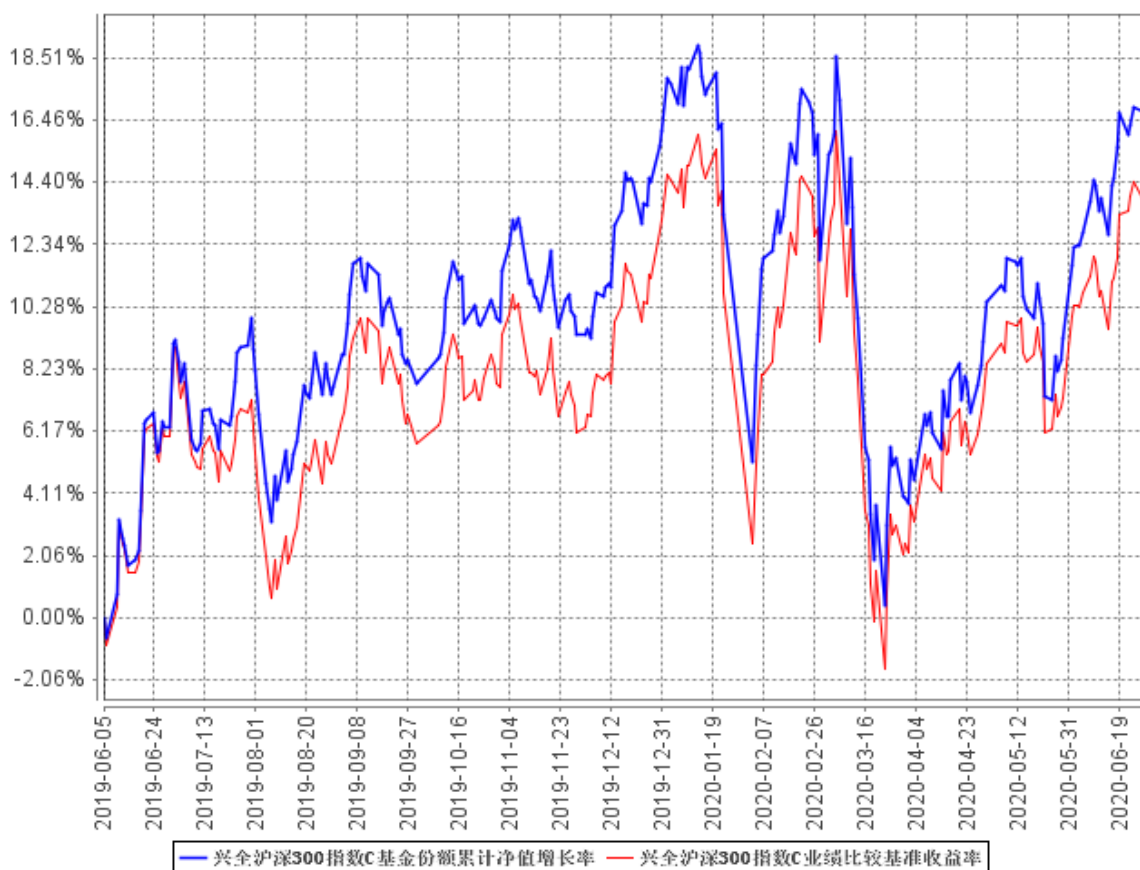
2、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

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

兴全沪深300指数（LOF）A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



兴全沪深300指数C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《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 2 日至 2011 年 5 月 1 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、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

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“兴证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	
申庆	本基金、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理	2010 年 11 月 2 日	-	23 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、基金管理部总监助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。
张晓峰	本基金基金经理助理	2015 年 12 月 16 日	-	9 年	理学硕士，2011 年加入兴全基金管理有限公司，历任 FOF 投资与金融工程部研究员、固定收益部研究员。

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、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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，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

在操作上我们始终坚持在保持总体行业和风格均衡前提下的行业内相对综合价值比较的选股策略。并积极把握各种确定性的超额收益或者相对行业或者市场表现基础上的绝对收益。从而在尽可能保持整体组合价值型、下方风险可控属性的基础上紧跟指数，并在未来市场的合理估值回归中处于有利位置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全沪深 300 指数（LOF）A 基金份额净值为 2.1778 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.42%；截至本报告期末兴全沪深 300 指数 C 基金份额净值为 2.1734 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.22%；同期业绩比较基准收益率为 1.64%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受疫情影响全球经济都在一季度出现了不同程度的“暂停”状况。二季度开始随着疫情的缓解，中国经济率先显著恢复。先行指标“制造业 PMI”从三月开始已连续 4 个月站上荣枯线，且持续向好。世界各国经济恢复虽有先后，但持续向好的趋势不变。从表观上判断，未来全球经济恢复的动能会比较强，且持续的时间会比较长。但这是以一季度经济活动停滞，产业结构大幅变化、行业内剧烈洗牌、贫富差距进一步扩大为代价。这些特征也是延续了 2008 年全球金融危机以来全球经济格局的大趋势，最后在今年一季度被“新冠疫情”被推向高峰。总之在正常情形下，未来不可能比今年的至暗时刻更差。我们要做好世界经济和金融由极端向均值回归的准备。

上半年 A 股市场也是向不同极端分化。具体可以概括为高估值板块表现显著优于低估值板块，小市值板块走势明显强于大市值板块，新兴行业涨幅大大超越传统行业。

上述的特征其实在 2019 年就已经出现，但除少数基本面确实不尽人意的板块和行业之外，多数行业和板块的市值至少还能同向而行，估值还能同步提升。而今年上半年以来成长与价值、大市值小市值、高估值与低估值几乎是背道而驰，并在二季度后期分化加速，市值与估值的差异越来越大。

如果只是少数优质行业的龙头公司在经济下行、疫情持续的大背景下出现鹤立鸡群的表现具有一定合理性，但若估值差异扩大化、极端化大面积的散开，就要考虑其合理性、持续性，甚至要预判极端高估值板块中的多数品种会不会出现未来长期性的估值和业绩双杀的情况。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具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》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—兴证全球基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金本年度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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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	2,561,022.99	30,364,634.83
结算备付金		5,633,911.64	9,699,011.99
存出保证金		489,895.06	377,991.67
交易性金融资产	6.4.7.2	5,313,006,098.96	5,242,421,873.78
其中：股票投资		4,831,481,326.08	4,793,241,057.76
基金投资		-	-
债券投资		481,524,772.88	449,180,816.02
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	115,700,000.00	-
应收证券清算款		7,171,818.16	1,179,151.45
应收利息	6.4.7.5	5,351,910.40	5,077,146.69
应收股利		-	-
应收申购款		28,983,586.74	157,088,850.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,478,898,243.95	5,446,208,660.93
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		286,119,236.61	200,899,835.45
应付证券清算款		8,844,138.68	31,459,720.71
应付赎回款		252,760,565.22	41,106,340.45
应付管理人报酬		3,556,738.65	3,235,000.71
应付托管费		666,888.51	606,562.63
应付销售服务费		38,300.57	41,406.21
应付交易费用	6.4.7.7	945,812.31	543,276.25
应交税费		2,154.92	2,241.76

应付利息		79,253.92	14,602.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	654,994.24	488,484.18
负债合计		553,668,083.63	278,397,470.92
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,261,657,549.01	2,430,393,556.81
未分配利润	6.4.7.10	2,663,572,611.31	2,737,417,633.20
所有者权益合计		4,925,230,160.32	5,167,811,190.01
负债和所有者权益总计		5,478,898,243.95	5,446,208,660.93

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，兴全沪深 300 指数（LOF）A 基金份额净值 2.1778 元，基金份额总额 2,212,030,034.37 份；兴全沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.1734 元，基金份额总额 49,627,514.64 份。兴全沪深 300 指数（LOF）份额总额合计为 2,261,657,549.01 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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		203,428,528.45	628,493,808.18
1.利息收入		4,975,087.43	2,433,153.77
其中：存款利息收入	6.4.7.11	147,161.07	131,121.63
债券利息收入		4,765,593.02	2,285,807.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		62,333.34	16,224.19
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		165,149,335.52	74,544,164.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	95,619,621.50	36,536,141.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,189,843.90	2,625,187.94
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	68,339,870.12	35,382,835.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,775,869.11	549,066,903.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,528,236.39	2,449,586.41
减：二、费用		31,685,783.19	15,436,848.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	21,399,829.24	10,817,873.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,012,468.01	2,028,351.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	255,407.43	12,318.97
4. 交易费用	6.4.7.19	3,455,007.29	1,178,529.33
5. 利息支出		2,006,373.48	1,035,254.15
其中：卖出回购金融资产支出		2,006,373.48	1,035,254.15
6. 税金及附加		1,750.98	849.95
7. 其他费用	6.4.7.20	554,946.76	363,670.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		171,742,745.26	613,056,959.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		171,742,745.26	613,056,959.99

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（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）	2,430,393,556.81	2,737,417,633.20	5,167,811,190.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	171,742,745.26	171,742,745.26
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）	-168,736,007.80	-245,587,767.15	-414,323,774.95
其中：1.基金申购款	1,761,752,777.80	1,801,806,042.61	3,563,558,820.41
2. 基金赎回款	-1,930,488,785.60	-2,047,393,809.76	-3,977,882,595.36
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)	2,261,657,549.01	2,663,572,611.31	4,925,230,160.32
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)	1,325,805,454.82	698,956,244.81	2,024,761,699.63
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	613,056,959.99	613,056,959.99
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)	425,591,904.33	348,626,756.23	774,218,660.56
其中: 1.基金申购款	1,348,475,264.31	1,117,157,071.85	2,465,632,336.16
2. 基金赎回款	-922,883,359.98	-768,530,315.62	-1,691,413,675.60
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)	1,751,397,359.15	1,660,639,961.03	3,412,037,320.18

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

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)(原名兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF))(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于 2010 年 11 月 2 日正式生效,首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 份基金份额。本基金为契约型上市开放式,存续期限

不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）。自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金的业绩基准为：沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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) 对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,561,022.99
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:	2,561,022.99

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	4,113,815,527.22	4,831,481,326.08	717,665,798.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	298,367,128.38	321,396,772.88
	银行间市场	161,079,810.00	160,128,000.00
	合计	459,446,938.38	481,524,772.88
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,573,262,465.60	5,313,006,098.96	739,743,633.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所市场	115,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	115,700,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,988.65
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	2,535.30
应收债券利息	5,334,592.44
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	11,573.61
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	220.40
合计	5,351,910.40

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	940,855.64
银行间市场应付交易费用	4,956.67
合计	945,812.31

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	225,549.40
应付证券出借违约金	—
预提费用	207,520.16
指数使用费	221,924.68
应付指数使用费	—

预提审计费	—
预提信息披露费	—
其他	—
合计	654,994.24

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A		
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	2,375,812,942.70	2,375,812,942.70
本期申购	1,684,534,677.65	1,684,534,677.65
本期赎回(以“-”号填列)	-1,848,317,585.98	-1,848,317,585.98
— 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	2,212,030,034.37	2,212,030,034.37

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 C		
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	54,580,614.11	54,580,614.11
本期申购	77,218,100.15	77,218,100.15
本期赎回(以“-”号填列)	-82,171,199.62	-82,171,199.62
— 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	49,627,514.64	49,627,514.64

注：1、申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,320,718,089.98	355,227,344.94	2,675,945,434.92
本期利润	140,120,835.29	26,895,213.47	167,016,048.76
本期基金份额交易产生的变动数	-176,030,882.40	-61,592,776.63	-237,623,659.03
其中：基金申购款	1,655,825,446.99	66,305,692.29	1,722,131,139.28
基金赎回款	-1,831,856,329.39	-127,898,468.92	-1,959,754,798.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,284,808,042.87	320,529,781.78	2,605,337,824.65

单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	48,480,404.43	12,991,793.85	61,472,198.28
本期利润	2,846,040.86	1,880,655.64	4,726,696.50
本期基金份额交易产生的变动数	-4,667,402.61	-3,296,705.51	-7,964,108.12
其中：基金申购款	68,875,547.90	10,799,355.43	79,674,903.33
基金赎回款	-73,542,950.51	-14,096,060.94	-87,639,011.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,659,042.68	11,575,743.98	58,234,786.66

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

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	61,331.67
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	82,357.30
其他	3,472.10
合计	147,161.07

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	1,341,695,885.24
减：卖出股票成本总额	1,246,076,263.74
买卖股票差价收入	95,619,621.50

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	1,189,843.90
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	1,189,843.90

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）成交总额	174,263,560.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	168,184,091.17
减：应收利息总额	4,889,625.62
买卖债券差价收入	1,189,843.90

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	68,339,870.12
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	68,339,870.12

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	28,775,869.11
——股票投资	26,389,581.75
——债券投资	2,386,287.36
——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	28,775,869.11

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	4,381,566.85
转换费收入	146,669.54
合计	4,528,236.39

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	3,453,107.29
银行间市场交易费用	1,900.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	3,455,007.29

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	27,847.82
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	—
账户维护费用	18,600.00
指数使用费	427,996.60
银行费用	20,830.00
上市费用	—
其他	—
合计	554,946.76

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、基金注册登记机构（C类份额）
中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）	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	2,516,613,240.19	100.00%	1,182,613,403.25	100.00%

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	38,979,423.55	100.00%	68,487,184.90	100.00%

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	8,484,365,000.00	100.00%	4,202,487,000.00	100.00%
------	------------------	---------	------------------	---------

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	1,847,587.94	100.00%	940,855.64	100.00%
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	866,840.75	100.00%	389,961.40	100.00%

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。

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	21,399,829.24	10,817,873.93
其中：支付销售机构的客户维护费	5,423,225.59	2,903,136.52

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 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×0.8%/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
----	----	---------

	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
当期发生的基金应支付的托管费	4,012,468.01	2,028,351.37

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴证全球基金	-	71,822.72	71,822.72
合计	-	71,822.72	71,822.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴证全球基金	-	11,981.27	11,981.27
合计	-	11,981.27	11,981.27

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日的基金资产净值×年销售服务费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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无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。

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无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。

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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

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

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可比期间末均未持有本基金。

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
农业银行	2,561,022.99	61,331.67	2,144,417.96	64,007.13

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

本基金报告内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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（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
600328	中盐化工	2020 年 4 月	2020 年 10 月	非公开发	6.58	6.87	759,878	4,999,997.24	5,220,361.86	注 1

		28 日	月 26 日	行流通受限						
603799	华友钴业	2020 年 4 月 23 日	2020 年 10 月 21 日	非公开发行流通受限	28.09	36.23	818,796	22,999,979.64	29,664,979.08	-
002765	蓝黛传动	2020 年 6 月 19 日	2020 年 12 月 22 日	非公开发行流通受限	3.33	4.10	1,501,501	4,999,998.33	6,156,154.10	-
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	150,000	4,591,500.00	5,043,000.00	-
000100	TCL 科技	2020 年 2 月 27 日	2020 年 8 月 27 日	大宗交易流通受限	6.12	5.95	18,800,000	115,056,000.00	111,860,000.00	-
002468	申通快递	2020 年 3 月 31 日	2020 年 10 月 1 日	大宗交易流通受限	15.15	15.72	500,000	7,575,000.00	7,860,000.00	-
002555	三七互娱	2020 年 5 月 21 日	2020 年 11 月 23 日	大宗交易流通受限	32.45	43.45	170,000	5,516,500.00	7,386,500.00	-
002624	完美世界	2020 年 3 月 12 日	2020 年 9 月 14 日	大宗交易流通受限	39.78	55.57	1,000,000	39,780,000.00	55,570,000.00	-
002773	康弘药业	2019 年 12 月 31 日	2020 年 7 月 1 日	大宗交易流通受限	33.46	49.60	777,505	26,015,317.30	38,564,248.00	-
000063	中兴通讯	2020 年 4 月 2 日	2020 年 10 月 2 日	大宗交易流通受限	38.16	38.32	800,000	30,528,000.00	30,656,000.00	-
000063	中兴通讯	2020 年 4 月	2020 年 10 月	大宗交易	37.69	38.18	500,000	18,845,000.00	19,090,000.00	-

		7 日	月 7 日	流通受限						
000938	紫光股份	2020 年 3 月 6 日	2020 年 9 月 7 日	大宗交易流通受限	43.56	41.45	250,000	10,890,000.00	10,362,500.00	-
000938	紫光股份	2020 年 3 月 10 日	2020 年 9 月 10 日	大宗交易流通受限	40.71	41.44	360,000	14,655,600.00	14,918,400.00	-
002558	巨人网络	2020 年 1 月 7 日	2020 年 7 月 7 日	大宗交易流通受限	17.69	17.28	850,000	15,036,500.00	14,688,000.00	-
002558	巨人网络	2020 年 1 月 13 日	2020 年 7 月 13 日	大宗交易流通受限	17.49	17.23	350,000	6,121,500.00	6,030,500.00	-
002558	巨人网络	2020 年 1 月 15 日	2020 年 7 月 15 日	大宗交易流通受限	17.56	17.22	680,000	11,940,800.00	11,709,600.00	-
002558	巨人网络	2020 年 1 月 22 日	2020 年 7 月 22 日	大宗交易流通受限	16.34	17.18	400,000	6,536,000.00	6,872,000.00	-
002558	巨人网络	2020 年 2 月 4 日	2020 年 8 月 4 日	大宗交易流通受限	15.19	17.12	4,000,000	60,760,000.00	68,480,000.00	-
002558	巨人网络	2020 年 3 月 10 日	2020 年 9 月 10 日	大宗交易流通受限	16.20	17.03	1,000,000	16,200,000.00	17,030,000.00	-
002558	巨人网络	2020 年 3 月 17 日	2020 年 9 月 17 日	大宗交易流通受限	15.73	17.00	600,000	9,438,000.00	10,200,000.00	-
002558	巨人网络	2020 年 3 月 25 日	2020 年 9 月 25 日	大宗交易流通受限	15.15	16.99	1,000,000	15,150,000.00	16,990,000.00	-
002558	巨人网络	2020 年 4 月	2020 年 10 月	大宗交易	14.95	16.98	2,018,473	30,176,171.35	34,273,671.54	-

		1 日	月 1 日	流通受限						
300413	芒果超媒	2020 年 3 月 6 日	2020 年 9 月 7 日	大宗交易流通受限	43.46	62.14	110,000	4,780,600.00	6,835,400.00	-
300413	芒果超媒	2020 年 4 月 20 日	2020 年 10 月 20 日	大宗交易流通受限	39.93	61.20	110,000	4,392,300.00	6,732,000.00	-
601360	三六零	2020 年 3 月 17 日	2020 年 9 月 17 日	大宗交易流通受限	18.07	17.69	500,000	9,035,000.00	8,845,000.00	-
601360	三六零	2020 年 3 月 25 日	2020 年 9 月 25 日	大宗交易流通受限	17.60	17.65	300,000	5,280,000.00	5,295,000.00	-
601360	三六零	2020 年 4 月 2 日	2020 年 10 月 2 日	大宗交易流通受限	17.00	17.62	300,000	5,100,000.00	5,286,000.00	-
688026	洁特生物	2020 年 1 月 15 日	2020 年 7 月 22 日	新股流通受限	16.49	83.32	4,433	73,100.17	369,357.56	-
688189	南新制药	2020 年 3 月 18 日	2020 年 9 月 28 日	新股流通受限	34.94	50.21	6,833	238,745.02	343,084.93	-
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	2020 年 7 月	新股流通	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

		22 日	月 1 日	受限						
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	-

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
128112	歌尔转 2	2020 年 6 月 12 日	2020 年 7 月 13 日	新发行未上市	100.00	100.00	2,181	218,100.00	218,100.00	-

注 1：经上海证券交易所核准，公司证券简称自 2020 年 6 月 5 日起由“兰太实业”变更为“中盐化工”。

注 2：流通受限证券可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

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

截止本报告期末 2020 年 6 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证余额 108,919,236.61 元，是如下证券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200401	20 农发 01	2020 年 7 月 6 日	100.09	100,000	10,009,000.00
190002	19 付息国债 02	2020 年 7 月 7 日	100.19	400,000	40,076,000.00
200201	20 国开 01	2020 年 7 月 7 日	100.14	100,000	10,014,000.00
2002120	20 国开抗疫 120	2020 年 7 月 7 日	99.60	400,000	39,840,000.00
170209	17 国开 09	2020 年 7 月 7 日	100.46	120,000	12,055,200.00
合计				1,120,000	111,994,200.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 177,200,000.00 元，于 2020 年 7 月 8 日、2020 年 7 月 13 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的证券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 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按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按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按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	153,140,040.22	150,503,416.04
AAA 以下	46,476,495.96	49,115,379.78
未评级	-	-
合计	199,616,536.18	199,618,795.82

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按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按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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末 202 0 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	2,561,022.99	-	-	-	-	-	2,561,022.99
结 算 备 付 金	5,633,911.64	-	-	-	-	-	5,633,911.64
存 出 保 证 金	489,895.06	-	-	-	-	-	489,895.06
交 易 性 金 融 资 产	35,991,598.80	95,822,215.20	152,406,617.40	131,795,206.88	65,509,134.60	4,831,481,326.08	5,313,006,098.96
买 入 返 售 金 融 资 产	115,700,000.00	-	-	-	-	-	115,700,000.00
应 收 证 券 清 算	-	-	-	-	-	7,171,818.16	7,171,818.16

算款							
应收利息	-	-	-	-	-	5,351,910.40	5,351,910.40
应收申购款	472,902.15	-	-	-	-	28,510,684.59	28,983,586.74
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	160,849,330.64	95,822,215.20	152,406,617.40	131,795,206.88	65,509,134.60	4,872,515,739.23	5,478,898,243.95
负债							
卖出回购金融资产款	286,119,236.61	-	-	-	-	-	286,119,236.61
应付证券清算款	-	-	-	-	-	8,844,138.68	8,844,138.68
应付赎回款	-	-	-	-	-	252,760,565.22	252,760,565.22
应付	-	-	-	-	-	3,556,738.65	3,556,738.65

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	666,888.51	666,888.51
应付销售服务费	-	-	-	-	-	38,300.57	38,300.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	945,812.31	945,812.31
应交税费	-	-	-	-	-	2,154.92	2,154.92
应付利息	-	-	-	-	-	79,253.92	79,253.92
其他负债	-	-	-	-	-	654,994.24	654,994.24
负债总计	286,119,236.61	-	-	-	-	267,548,847.02	553,668,083.63
利率敏感度	-125,269,905.97	95,822,215.20	152,406,617.40	131,795,206.88	65,509,134.60	4,604,966,892.21	4,925,230,160.32

缺口							
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	30,364,634.83	-	-	-	-	-	30,364,634.83
结算备付金	9,699,011.99	-	-	-	-	-	9,699,011.99
存出保证金	377,991.67	-	-	-	-	-	377,991.67
交易性金融资产	26,887,775.10	21,305,969.14	218,573,567.60	97,992,617.84	84,420,886.34	4,793,241,057.76	5,242,421,873.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,179,151.45	1,179,151.45
应收	-	-	-	-	-	5,077,146.69	5,077,146.69

利息							
应收申购款	140,686,885.06	-	-	-	-	16,401,965.46	157,088,850.52
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	208,016,298.65	21,305,969.14	218,573,567.60	97,992,617.84	84,420,886.34	4,815,899,321.36	5,446,208,660.93
负债							
卖出回购金融资产款	200,899,835.45	-	-	-	-	-	200,899,835.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-	31,459,720.71	31,459,720.71
应付赎回款	-	-	-	-	-	41,106,340.45	41,106,340.45
应付管理人报	-	-	-	-	-	3,235,000.71	3,235,000.71

酬							
应付 托管费	-	-	-	-	-	606,562.63	606,562.63
应付 销售 服务费	-	-	-	-	-	41,406.21	41,406.21
应付 交易 费用	-	-	-	-	-	543,276.25	543,276.25
应交 税费	-	-	-	-	-	2,241.76	2,241.76
应付 利息	-	-	-	-	-	14,602.57	14,602.57
其他 负债	-	-	-	-	-	488,484.18	488,484.18
负债 总计	200,899,835.45	-	-	-	-	77,497,635.47	278,397,470.92
利率 敏感 度缺 口	7,116,463.20	21,305,969.14	218,573,567.60	97,992,617.84	84,420,886.34	4,738,401,685.89	5,167,811,190.01

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%	-1,081,220.14	-1,111,369.76
	利率 -1%	1,092,966.70	1,123,636.76

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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	4,831,481,326.08	98.10	4,793,241,057.76	92.75
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	481,524,772.88	9.78	449,180,816.02	8.69
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	5,313,006,098.96	107.88	5,242,421,873.78	101.44

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 +10%	517,254,590.16	480,795,622.82
	业绩比较基准 -10%	-517,254,590.16	-480,795,622.82

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	4,831,481,326.08	88.18
	其中：股票	4,831,481,326.08	88.18
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	481,524,772.88	8.79
	其中：债券	481,524,772.88	8.79
	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	115,700,000.00	2.11
	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	8,194,934.63	0.15
8	其他各项资产	41,997,210.36	0.77
9	合计	5,478,898,243.95	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	2,534,468.00	0.05
B	采矿业	114,058,161.35	2.32
C	制造业	2,024,040,272.97	41.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	76,262,271.57	1.55
E	建筑业	70,392,707.87	1.43
F	批发和零售业	41,600,959.89	0.84
G	交通运输、仓储和邮政业	135,720,857.36	2.76
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	396,404,370.84	8.05
J	金融业	1,299,970,633.81	26.39
K	房地产业	145,264,628.98	2.95
L	租赁和商务服务业	217,366,881.27	4.41

M	科学研究和技术服务业	897,607.20	0.02
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	16,642,109.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	42,828,897.80	0.87
S	综合	-	-
	合计	4,583,984,827.91	93.07

7.2.2 期末积极投资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	12,143,099.25	0.25
C	制造业	172,500,504.51	3.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,842,252.71	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	167,256.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,669,134.97	0.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	652,280.40	0.01
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	849,596.97	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	48,656,908.40	0.99
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,698.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	247,496,498.17	5.03

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	3,680,000	262,752,000.00	5.33
2	000100	TCL 科技	38,610,800	234,686,960.00	4.76
3	600519	贵州茅台	148,800	217,676,544.00	4.42
4	601888	中国中免	1,388,000	213,793,640.00	4.34
5	002773	康弘药业	3,818,947	189,419,771.20	3.85
6	002558	巨人网络	10,898,473	186,273,771.54	3.78
7	000895	双汇发展	3,768,926	173,709,799.34	3.53
8	601601	中国太保	6,371,800	173,631,550.00	3.53
9	000938	紫光股份	3,699,605	158,072,122.90	3.21
10	600036	招商银行	3,738,001	126,045,393.72	2.56
11	601336	新华保险	2,748,743	121,714,340.04	2.47
12	601009	南京银行	13,876,002	101,711,094.66	2.07
13	600690	海尔智家	5,569,700	98,583,690.00	2.00
14	000858	五 粮 液	533,565	91,303,642.80	1.85
15	600741	华域汽车	4,387,900	91,224,441.00	1.85
16	002555	三七互娱	1,878,000	87,320,900.00	1.77
17	601166	兴业银行	5,308,418	83,766,836.04	1.70
18	000333	美的集团	1,080,378	64,595,800.62	1.31
19	600276	恒瑞医药	632,057	58,338,861.10	1.18
20	001979	招商蛇口	3,529,442	58,024,026.48	1.18
21	002624	完美世界	1,000,000	55,570,000.00	1.13
22	000001	平安银行	4,142,000	53,017,600.00	1.08
23	600309	万华化学	1,002,040	50,091,979.60	1.02
24	000063	中兴通讯	1,300,000	49,746,000.00	1.01
25	601997	贵阳银行	6,580,000	47,112,800.00	0.96
26	600000	浦发银行	4,397,800	46,528,724.00	0.94
27	600009	上海机场	621,700	44,805,919.00	0.91
28	601628	中国人寿	1,541,000	41,930,610.00	0.85
29	601328	交通银行	8,109,500	41,601,735.00	0.84
30	300124	汇川技术	1,076,300	40,888,637.00	0.83
31	000651	格力电器	708,891	40,101,963.87	0.81
32	601838	成都银行	4,700,000	37,412,000.00	0.76
33	601398	工商银行	7,020,200	34,960,596.00	0.71

34	601225	陕西煤业	4,704,000	33,915,840.00	0.69
35	600585	海螺水泥	635,673	33,633,458.43	0.68
36	600233	圆通速递	2,157,800	31,417,568.00	0.64
37	000069	华侨城 A	5,090,600	30,849,036.00	0.63
38	601668	中国建筑	6,314,500	30,120,165.00	0.61
39	600383	金地集团	2,168,665	29,710,710.50	0.60
40	603799	华友钴业	818,796	29,664,979.08	0.60
41	000338	潍柴动力	2,071,300	28,418,236.00	0.58
42	601088	中国神华	1,944,900	27,928,764.00	0.57
43	600900	长江电力	1,443,625	27,342,257.50	0.56
44	601607	上海医药	1,483,100	27,259,378.00	0.55
45	000568	泸州老窖	293,327	26,727,956.24	0.54
46	600048	保利地产	1,805,200	26,680,856.00	0.54
47	600406	国电南瑞	1,226,500	24,836,625.00	0.50
48	002422	科伦药业	1,166,900	24,504,900.00	0.50
49	601899	紫金矿业	5,407,680	23,793,792.00	0.48
50	601006	大秦铁路	3,268,700	23,011,648.00	0.47
51	600104	上汽集团	1,345,900	22,866,841.00	0.46
52	600674	川投能源	2,197,341	20,369,351.07	0.41
53	002142	宁波银行	758,727	19,931,758.29	0.40
54	600019	宝钢股份	4,272,880	19,484,332.80	0.40
55	601360	三六零	1,100,000	19,426,000.00	0.39
56	601988	中国银行	5,534,600	19,260,408.00	0.39
57	002739	万达电影	1,246,650	19,036,345.50	0.39
58	600016	民生银行	3,261,700	18,493,839.00	0.38
59	600196	复星医药	539,200	18,251,920.00	0.37
60	600436	片仔癀	106,300	18,097,575.00	0.37
61	000157	中联重科	2,766,016	17,785,482.88	0.36
62	600028	中国石化	4,408,385	17,236,785.35	0.35
63	002044	美年健康	1,154,900	16,642,109.00	0.34
64	601985	中国核电	4,049,200	16,561,228.00	0.34
65	601169	北京银行	3,347,300	16,401,770.00	0.33
66	300413	芒果超媒	259,226	16,124,935.20	0.33
67	002007	华兰生物	315,141	15,791,715.51	0.32
68	600760	中航沈飞	446,700	14,660,694.00	0.30
69	601186	中国铁建	1,653,915	13,859,807.70	0.28
70	601818	光大银行	3,776,900	13,521,302.00	0.27
71	600637	东方明珠	1,288,000	12,429,200.00	0.25
72	600271	航天信息	757,200	12,296,928.00	0.25

73	601229	上海银行	1,419,836	11,784,638.80	0.24
74	002008	大族激光	320,900	11,536,355.00	0.23
75	603156	养元饮品	518,000	11,137,000.00	0.23
76	002352	顺丰控股	194,418	10,634,664.60	0.22
77	000625	长安汽车	966,516	10,631,676.00	0.22
78	600010	宝钢股份	8,714,900	9,412,092.00	0.19
79	601012	隆基股份	224,600	9,147,958.00	0.19
80	000768	中航飞机	490,521	8,701,842.54	0.18
81	600660	福耀玻璃	395,700	8,258,259.00	0.17
82	601390	中国中铁	1,593,800	8,000,876.00	0.16
83	002468	申通快递	500,000	7,860,000.00	0.16
84	600188	兖州煤业	848,300	7,431,108.00	0.15
85	601939	建设银行	1,177,400	7,429,394.00	0.15
86	600893	航发动力	309,224	7,260,579.52	0.15
87	601800	中国交建	961,300	7,055,942.00	0.14
88	600498	烽火通信	241,723	6,988,211.93	0.14
89	601877	正泰电器	256,600	6,761,410.00	0.14
90	600085	同仁堂	242,400	6,573,888.00	0.13
91	000538	云南白药	69,552	6,524,673.12	0.13
92	600795	国电电力	3,472,400	6,423,940.00	0.13
93	002601	龙鳞佰利	332,252	6,146,662.00	0.12
94	601138	工业富联	398,404	6,035,820.60	0.12
95	600221	海航控股	3,850,700	5,776,050.00	0.12
96	600170	上海建工	1,877,311	5,763,344.77	0.12
97	600332	白云山	177,100	5,725,643.00	0.12
98	600655	豫园股份	643,414	5,700,648.04	0.12
99	600362	江西铜业	399,313	5,374,752.98	0.11
100	000725	京东方 A	1,146,870	5,355,882.90	0.11
101	601688	华泰证券	284,200	5,342,960.00	0.11
102	600068	葛洲坝	866,832	5,157,650.40	0.10
103	002241	歌尔股份	171,273	5,028,575.28	0.10
104	600118	中国卫星	161,903	4,991,469.49	0.10
105	600089	特变电工	735,408	4,978,712.16	0.10
106	600050	中国联通	1,026,000	4,965,840.00	0.10
107	601600	中国铝业	1,787,900	4,934,604.00	0.10
108	600926	杭州银行	520,754	4,645,125.68	0.09
109	600030	中信证券	186,700	4,501,337.00	0.09
110	603833	欧派家居	34,229	3,967,141.10	0.08
111	600977	中国电影	300,000	3,939,000.00	0.08

112	600372	中航电子	290,900	3,874,788.00	0.08
113	002271	东方雨虹	92,900	3,774,527.00	0.08
114	300144	宋城演艺	215,527	3,728,617.10	0.08
115	600018	上港集团	831,339	3,491,623.80	0.07
116	600004	白云机场	224,117	3,415,543.08	0.07
117	002027	分众传媒	611,276	3,404,807.32	0.07
118	600886	国投电力	427,300	3,358,578.00	0.07
119	002153	石基信息	80,600	3,145,818.00	0.06
120	002024	苏宁易购	327,577	2,872,850.29	0.06
121	601021	春秋航空	80,487	2,836,361.88	0.06
122	600219	南山铝业	1,335,000	2,710,050.00	0.06
123	600297	广汇汽车	822,050	2,622,339.50	0.05
124	002252	上海莱士	303,500	2,567,610.00	0.05
125	300498	温氏股份	116,260	2,534,468.00	0.05
126	601111	中国国航	373,900	2,471,479.00	0.05
127	600588	用友网络	55,243	2,436,216.30	0.05
128	002415	海康威视	80,000	2,428,000.00	0.05
129	600989	宝丰能源	277,300	2,334,866.00	0.05
130	601633	长城汽车	298,700	2,305,964.00	0.05
131	600025	华能水电	582,300	2,206,917.00	0.04
132	002594	比亚迪	27,748	1,992,306.40	0.04
133	601933	永辉超市	200,762	1,883,147.56	0.04
134	000776	广发证券	132,300	1,868,076.00	0.04
135	603993	洛阳钼业	499,800	1,834,266.00	0.04
136	601658	邮储银行	398,384	1,820,614.88	0.04
137	600999	招商证券	74,032	1,625,002.40	0.03
138	300122	智飞生物	14,000	1,402,100.00	0.03
139	000963	华东医药	49,905	1,262,596.50	0.03
140	601916	浙商银行	294,195	1,159,128.30	0.02
141	601808	中海油服	87,200	1,145,808.00	0.02
142	002179	中航光电	27,210	1,115,882.10	0.02
143	002236	大华股份	51,416	987,701.36	0.02
144	603259	药明康德	9,292	897,607.20	0.02
145	300408	三环集团	29,585	819,504.50	0.02
146	601857	中国石油	184,200	771,798.00	0.02
147	600031	三一重工	29,241	548,561.16	0.01
148	600111	北方稀土	49,600	462,272.00	0.01
149	002938	鹏鼎控股	8,980	449,538.80	0.01
150	601669	中国电建	125,700	434,922.00	0.01

151	601828	美凯龙	15,905	168,433.95	0.00
152	600438	通威股份	9,039	157,097.82	0.00
153	300433	蓝思科技	287	8,047.48	0.00
154	002916	深南电路	18	3,015.36	0.00

7.3.2 期末积极投资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	600195	中牧股份	3,388,800	55,000,224.00	1.12
2	300450	先导智能	990,200	45,757,142.00	0.93
3	300070	碧水源	4,825,200	39,180,624.00	0.80
4	002821	凯莱英	121,418	29,504,574.00	0.60
5	000423	东阿阿胶	401,499	14,377,679.19	0.29
6	601200	上海环境	788,000	9,456,000.00	0.19
7	600535	天士力	496,620	8,055,176.40	0.16
8	002765	蓝黛传动	1,501,501	6,156,154.10	0.12
9	000983	西山煤电	1,551,031	5,816,366.25	0.12
10	600328	中盐化工	759,878	5,220,361.86	0.11
11	300609	汇纳科技	150,000	5,043,000.00	0.10
12	601699	潞安环能	756,100	4,211,477.00	0.09
13	600153	建发股份	478,800	3,878,280.00	0.08
14	600739	辽宁成大	100,000	1,893,000.00	0.04
15	600395	盘江股份	288,800	1,545,080.00	0.03
16	300760	迈瑞医疗	4,800	1,467,360.00	0.03
17	000060	中金岭南	345,700	1,286,004.00	0.03
18	688200	华峰测控	3,780	1,082,025.00	0.02
19	688505	复旦张江	22,688	772,072.64	0.02
20	000402	金融街	98,235	652,280.40	0.01
21	688086	紫晶存储	9,361	634,582.19	0.01
22	000937	冀中能源	188,800	570,176.00	0.01
23	600718	东软集团	47,475	545,962.50	0.01
24	600060	海信视像	34,201	415,542.15	0.01
25	300699	光威复材	6,149	385,726.77	0.01
26	688026	洁特生物	4,433	369,357.56	0.01
27	688189	南新制药	6,833	343,084.93	0.01
28	300454	深信服	1,604	330,359.84	0.01
29	688202	美迪西	2,120	293,196.00	0.01

30	300676	华大基因	1,847	287,965.77	0.01
31	002920	德赛西威	4,569	280,216.77	0.01
32	300759	康龙化成	2,728	268,435.20	0.01
33	688004	博汇科技	2,500	249,875.00	0.01
34	300713	英可瑞	18,921	226,105.95	0.00
35	002439	启明星辰	4,418	185,865.26	0.00
36	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
37	601866	中远海发	90,900	167,256.00	0.00
38	300832	新产业	882	151,871.58	0.00
39	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
40	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
41	300672	国科微	2,003	102,974.23	0.00
42	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
43	603387	基蛋生物	2,332	93,956.28	0.00
44	002955	鸿合科技	1,884	57,273.60	0.00
45	603662	柯力传感	1,052	48,655.00	0.00
46	300766	每日互动	1,193	45,405.58	0.00
47	603516	淳中科技	1,173	44,785.14	0.00
48	603214	爱婴室	1,287	39,472.29	0.00
49	300678	中科信息	1,860	39,208.80	0.00
50	300622	博士眼镜	2,506	31,500.42	0.00
51	300691	联合光电	2,069	31,407.42	0.00
52	603365	水星家纺	2,111	30,461.73	0.00
53	603773	沃格光电	881	28,694.17	0.00
54	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
55	002835	同为股份	2,252	25,222.40	0.00
56	603607	京华激光	1,439	22,376.45	0.00
57	300588	熙菱信息	2,208	20,953.92	0.00
58	300692	中环环保	1,615	20,284.40	0.00
59	603321	梅轮电梯	2,725	19,156.75	0.00
60	603848	好太太	1,377	18,796.05	0.00
61	002899	英派斯	1,408	18,557.44	0.00
62	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
63	300730	科创信息	1,395	17,772.30	0.00
64	603161	科华控股	1,239	17,469.90	0.00
65	002922	伊戈尔	1,245	17,118.75	0.00
66	603063	禾望电气	2,361	16,810.32	0.00
67	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
68	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00

69	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
70	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
71	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
72	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
73	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
74	300788	中信出版	56	2,698.64	0.00
75	603277	银都股份	10	109.20	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	002558	巨人网络	172,389,771.35	3.34
2	000100	TCL 科技	115,949,664.00	2.24
3	601318	中国平安	63,958,760.70	1.24
4	300450	先导智能	52,468,460.00	1.02
5	000063	中兴通讯	52,178,109.00	1.01
6	601601	中国太保	51,536,833.80	1.00
7	002624	完美世界	39,780,000.00	0.77
8	600233	圆通速递	33,474,699.87	0.65
9	601997	贵阳银行	28,995,877.01	0.56
10	600036	招商银行	28,347,672.13	0.55
11	000938	紫光股份	25,545,600.00	0.49
12	601009	南京银行	23,100,867.00	0.45
13	603799	华友钴业	22,999,979.64	0.45
14	600741	华域汽车	22,854,538.08	0.44
15	600690	海尔智家	22,459,265.36	0.43
16	601888	中国中免	22,344,742.26	0.43
17	601398	工商银行	21,666,000.00	0.42
18	001979	招商蛇口	21,396,227.00	0.41
19	000001	平安银行	20,277,694.46	0.39
20	601360	三六零	19,415,000.00	0.38

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	601318	中国平安	89,633,465.70	1.73
2	601601	中国太保	63,880,386.05	1.24
3	601997	贵阳银行	46,314,940.98	0.90
4	002555	三七互娱	39,982,243.21	0.77
5	601009	南京银行	37,787,530.16	0.73
6	601336	新华保险	36,490,246.38	0.71
7	600036	招商银行	36,346,963.82	0.70
8	600741	华域汽车	36,247,476.99	0.70
9	600690	海尔智家	35,766,481.42	0.69
10	000895	双汇发展	32,374,727.35	0.63
11	601398	工商银行	31,142,894.00	0.60
12	000063	中兴通讯	29,192,166.70	0.56
13	601166	兴业银行	27,641,498.99	0.53
14	601888	中国中免	26,265,337.88	0.51
15	600233	圆通速递	26,041,319.26	0.50
16	002382	蓝帆医疗	23,891,256.35	0.46
17	601628	中国人寿	21,120,035.39	0.41
18	001979	招商蛇口	19,236,447.54	0.37
19	002558	巨人网络	18,439,501.96	0.36
20	600050	中国联通	17,204,645.00	0.33

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	1,257,933,080.31
卖出股票收入（成交）总额	1,341,695,885.24

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	70,636,250.00	1.43

2	央行票据	-	-
3	金融债券	211,271,986.70	4.29
	其中：政策性金融债	211,271,986.70	4.29
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）	199,616,536.18	4.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	481,524,772.88	9.78

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	170209	17 国开 09	500,000	50,230,000.00	1.02
2	190002	19 附息国债 02	400,000	40,076,000.00	0.81
3	2002120	20 国开抗疫 120	400,000	39,840,000.00	0.81
4	132018	G 三峡 EB1	333,880	37,047,324.80	0.75
5	108801	进出 1901	359,880	35,991,598.80	0.73

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	489,895.06
2	应收证券清算款	7,171,818.16
3	应收股利	-
4	应收利息	5,351,910.40
5	应收申购款	28,983,586.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	41,997,210.36

7.13.4 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	132018	G 三峡 EB1	37,047,324.80	0.75
2	128080	顺丰转债	27,784,483.20	0.56
3	110059	浦发转债	20,621,569.50	0.42
4	110051	中天转债	19,237,011.00	0.39
5	132015	18 中油 EB	12,718,000.00	0.26
6	132014	18 中化 EB	11,491,184.00	0.23
7	113020	桐昆转债	4,940,040.00	0.10
8	110061	川投转债	2,443,576.00	0.05
9	113527	维格转债	2,345,954.40	0.05
10	132013	17 宝武 EB	2,135,584.70	0.04
11	110041	蒙电转债	2,131,600.00	0.04
12	113525	台华转债	2,067,249.60	0.04
13	113021	中信转债	1,604,897.70	0.03
14	113026	核能转债	1,591,044.80	0.03
15	110062	烽火转债	1,490,284.50	0.03
16	113011	光大转债	1,191,927.00	0.02
17	110053	苏银转债	1,115,337.60	0.02
18	128022	众信转债	845,120.00	0.02
19	113537	文灿转债	837,792.20	0.02
20	113028	环境转债	808,998.00	0.02
21	127005	长证转债	723,168.00	0.01
22	127012	招路转债	705,110.00	0.01
23	110057	现代转债	528,182.10	0.01
24	113025	明泰转债	499,515.90	0.01
25	113027	华钰转债	412,799.40	0.01
26	128086	国轩转债	401,922.90	0.01
27	128085	鸿达转债	317,163.20	0.01
28	113022	浙商转债	307,165.30	0.01
29	128057	博彦转债	297,625.60	0.01
30	128084	木森转债	290,159.10	0.01
31	127006	敖东转债	257,508.92	0.01
32	128081	海亮转债	234,746.20	0.00
33	113534	鼎胜转债	226,907.20	0.00
34	113528	长城转债	219,114.60	0.00
35	123022	长信转债	218,134.80	0.00
36	113029	明阳转债	216,348.30	0.00

37	110056	亨通转债	215,371.90	0.00
38	128059	视源转债	212,544.00	0.00
39	110060	天路转债	208,291.50	0.00
40	113024	核建转债	199,099.50	0.00
41	128062	亚药转债	193,721.50	0.00
42	110052	贵广转债	189,157.50	0.00
43	110065	淮矿转债	177,189.60	0.00
44	132012	17 巨化 EB	176,610.00	0.00
45	113545	金能转债	158,672.40	0.00
46	127013	创维转债	154,076.00	0.00
47	128075	远东转债	153,413.00	0.00
48	128064	司尔转债	144,215.50	0.00
49	113554	仙鹤转债	132,631.20	0.00
50	110058	永鼎转债	130,314.70	0.00
51	113530	大丰转债	118,661.40	0.00
52	123023	迪森转债	113,007.20	0.00
53	110055	伊力转债	97,072.00	0.00
54	110042	航电转债	92,742.00	0.00
55	127011	中鼎转 2	51,260.00	0.00
56	113030	东风转债	30,514.40	0.00
57	113543	欧派转债	12,439.00	0.00
58	123026	中环转债	3,188.84	0.00
59	110043	无锡转债	3,081.90	0.00
60	110038	济川转债	1,151.10	0.00
61	113505	杭电转债	1,010.80	0.00

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资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	000100	TCL 科技	111,860,000.00	2.27	大宗交易购入流通受限
2	002773	康弘药业	38,564,248.00	0.78	大宗交易购入流通受限
3	002558	巨人网络	186,273,771.54	3.78	大宗交易购入流通受限
4	000938	紫光股份	25,280,900.00	0.51	大宗交易购入流通受限

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

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

份额级别	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
兴全沪深 300 指数 (LOF) A	585,324	3,779.15	657,538,874.78	29.73%	1,554,491,159.59	70.27%
兴全沪深 300 指数 C	26,437	1,877.20	15,025,267.21	30.28%	34,602,247.43	69.72%
合计	611,761	3,696.96	672,564,141.99	29.74%	1,589,093,407.02	70.26%

8.2 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	东方电气集团财务有限公司	1,698,145.00	3.71%
2	高德荣	1,435,089.00	3.14%
3	欧阳兰	1,098,067.00	2.40%
4	钟贵洋	886,928.00	1.94%
5	于扬	748,437.00	1.64%
6	何雅丽	714,811.00	1.56%
7	邱贤奕	493,500.00	1.08%
8	丁萍	483,008.00	1.06%
9	陆娥英	481,903.00	1.05%
10	王静	443,954.00	0.97%

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	份额级别	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	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	4,392,636.32	0.1986%
	兴全沪深 300 指数 C	26,415.63	0.0532%

	合计	4,419,051.95	0.1954%
--	----	--------------	---------

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	份额级别	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	兴全沪深 300 指数（LOF）A	0~10
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全沪深 300 指数（LOF）A	>100
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2010 年 11 月 2 日）基金份额总额	2,955,476,122.49	—
本报告期期初基金份额总额	2,375,812,942.70	54,580,614.11
本报告期基金总申购份额	1,684,534,677.65	77,218,100.15
减：本报告期基金总赎回份额	1,848,317,585.98	82,171,199.62
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	2,212,030,034.37	49,627,514.64

注：1、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。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额。

§ 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——德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	2,516,613,240.19	100.00%	1,847,587.94	100.00%	-

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	成交金额	占当期权证成交总额

				的比例		的比例
兴业证券	38,979,423.55	100.00%	8,484,365,000.00	100.00%	-	-

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	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 份额参加民生银行定期定额投资费率优惠的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 1 月 8 日
2	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 1 月 13 日
3	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 1 月 31 日
4	关于使用自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 2 月 3 日
5	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 2 月 6 日
6	关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 3 月 13 日
7	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 份额开通转换业务的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 3 月 17 日
8	关于公司法定名称变更的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 3 月 19 日
9	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 3 月 20 日
10	关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 3 月 26 日
11	关于旗下部分基金投资兰太实业（600328）非公开发行股票的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 4 月 30 日
12	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 5 月 12 日
13	关于在东方证券开通旗下部分基金定投业务的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 5 月 21 日

14	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 5 月 22 日
15	关于变更直销中心银行账户信息的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 5 月 25 日
16	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 6 月 2 日
17	关于旗下部分基金投资汇纳科技(300609)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 6 月 10 日
19	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 6 月 12 日
20	关于增加国盛证券为旗下部分基金代销机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 6 月 19 日
21	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	证券时报及规定互联网网站	2020 年 6 月 19 日
22	关于旗下部分基金投资蓝黛传动(002765)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2020 年 6 月 23 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、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

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