

兴全精选混合型证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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 托管人对本中期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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 市场中性策略执行情况	52
7.13 投资组合报告附注	52
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	54
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	54
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57

§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全精选混合型证券投资基金
基金简称	兴全精选混合
场内简称	—
基金主代码	163411
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 3 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,289,326,482.99 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	本基金投资于优秀公司或有潜力成为优秀公司的股票，力争获取当期收益及实现长期资本增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 在大类资产配置上，本基金采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。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。 2、行业配置策略 本基金的行业配置主要通过行业基本面筛选与行业估值筛选两大筛选体系实现，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的行业及公司，追求超额收益。 3、股票精选策略 本基金运用静态与动态预期数据相结合的方式考察股票的估值水平、财务指标、成长风格、盈利水平。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金产品，预期风险与预期收益高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	林兴盛
	联系电话	021-20398888	021-52629999-213707
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	linxingsheng@cib.com.cn

客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95561
传真	021-20398858	021-62159217
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	福州市湖东路 154 号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	201204	200041
法定代表人	兰荣	高建平

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	80,649,506.18
本期利润	620,665,860.83
加权平均基金份额本期利润	0.4768
本期加权平均净值利润率	20.29%
本期基金份额净值增长率	27.44%
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	1,341,869,998.00
期末可供分配基金份额利润	1.0408
期末基金资产净值	3,563,080,513.54
期末基金份额净值	2.7635
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	220.79%

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	14.50%	1.17%	5.92%	0.71%	8.58%	0.46%
过去三个月	32.10%	1.40%	10.05%	0.72%	22.05%	0.68%
过去六个月	27.44%	1.93%	2.09%	1.20%	25.35%	0.73%
过去一年	65.21%	1.56%	8.54%	0.97%	56.67%	0.59%
过去三年	109.93%	1.53%	11.22%	0.99%	98.71%	0.54%
自基金合同生效起至今	220.79%	0.94%	39.92%	0.58%	180.87%	0.36%

注：1、本基金业绩比较基准： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中证国债指数收益率}$ 。

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：

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

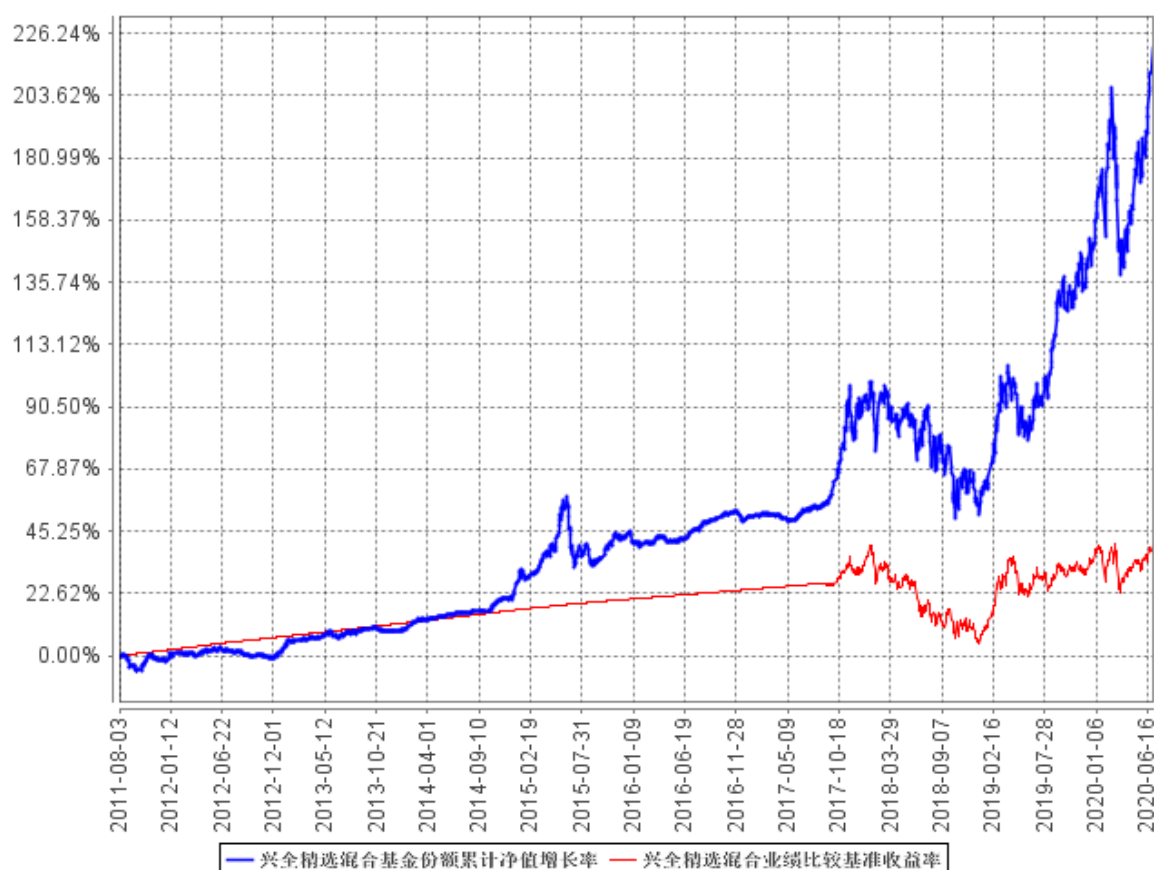
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

2、根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，兴全精选混合型证券投资基金由兴全保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型而来。由于兴全保本在第二个保本周期届满后不再符合保本基金存续条件，根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，自 2017 年 9 月 6 日起兴全保本转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“兴全精选混合型证券投资基金”，《兴全精选混合型证券投资基金基金合同》及《兴全精选混合型证券投资基金托管协议》自该日起生效。

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

兴全精选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 2020 年 6 月 30 日。

2、本基金由兴全保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期后转型而来，按照《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的规定，建仓期为 2011 年 8 月 3 日至 2012 年 2 月 2 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、由于兴全保本在第二个保本周期届满后不再符合保本基金存续条件，根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，自 2017 年 9 月 6 日起兴全保本转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“兴全精选混合型证券投资基金”，业绩比较基准自该日起变更为 $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中证国债指数收益率}$ 。

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	
陈宇	本基金基金经理	2017 年 9 月 6 日	-	13 年	理学硕士，历任兴业证券研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、专户投资部投资经理、兴全可转债混合型证券投资基金基金经理。

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

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

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

4.1.3 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、《兴全精选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

2020 年上半年是跌宕起伏的半年，先后经历了国内疫情、国外疫情、美国对华为制裁加压等诸多事件冲击。为了抗击新冠疫情，国内外都采取了较为宽松的货币政策和比较积极的财政政策，经济在短暂休克后逐渐重启，pmi 等前瞻指标都开始慢慢好转，投资者也从“百年一遇”的疫情灾害中逐渐恢复心态和生活工作的正常化，资本市场先暴跌，然后逐渐企稳反弹。

国内的经济结构调整加快，坚持房住不炒，从新经济中找动能。资本市场的制度创新也空前活跃，股票供给增加，对投资者既是挑战又是机遇。本基金重点配置了大消费、科技领域和中游制造，争取在做好风控的前提下，为投资者赚得优秀公司的成长红利。

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 2.7635 元；本报告期基金份额净值增长率为 27.44%，业绩比较基准收益率为 2.09%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济大概率以非常缓慢的速度恢复，海外冲击常态化，自主创新常态化。货币政策的进一步宽松难现，但考虑到国内就业压力和中美贸易摩擦，政策层面仍会坚持托底。新经济在压力中坚韧成长，中游制造业和周期性行业在比较稳定的竞争势态下，龙头公司可能有不错的盈利。结构性机会仍然存在，本基金将积极配置。

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》、《兴全精选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，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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全精选混合型证券投资基金

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	175,477,387.41	52,530,942.20
结算备付金		7,380,081.77	3,945,877.04
存出保证金		2,406,562.62	652,697.23
交易性金融资产	6.4.7.2	3,453,073,413.21	1,460,865,044.03
其中：股票投资		3,232,093,413.21	1,360,089,328.23
基金投资		-	-
债券投资		220,980,000.00	100,775,715.80
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		96,345,649.25	-
应收利息	6.4.7.5	7,091,643.87	3,010,638.83
应收股利		-	-
应收申购款		53,403,749.94	10,277,742.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,795,178,488.07	1,531,282,941.49
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		49,399,855.30	-
应付证券清算款		7,066,733.25	25,285,516.36
应付赎回款		165,236,883.92	15,564,522.56
应付管理人报酬		4,241,901.72	1,772,165.15
应付托管费		706,983.60	295,360.86
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,148,079.16	1,815,429.33
应交税费		-	0.69

应付利息		3,528.26	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	294,009.32	187,146.74
负债合计		232,097,974.53	44,920,141.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,110,722,059.80	590,473,147.75
未分配利润	6.4.7.10	2,452,358,453.74	895,889,652.05
所有者权益合计		3,563,080,513.54	1,486,362,799.80
负债和所有者权益总计		3,795,178,488.07	1,531,282,941.49

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.7635 元，基金份额总额 1,289,326,482.99 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全精选混合型证券投资基金

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		669,247,458.96	208,432,453.61
1.利息收入		4,910,926.38	1,224,062.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,123,272.84	341,230.20
债券利息收入		3,787,653.54	879,942.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,890.40
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		115,594,894.49	82,347,686.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	108,504,221.01	87,249,717.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-424,419.78	-9,448,361.98
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	7,515,093.26	4,546,331.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	540,016,354.65	123,638,033.21
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	8,725,283.44	1,222,670.60
减：二、费用		48,581,598.13	13,060,340.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,657,356.47	6,518,576.76
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,776,226.06	1,086,429.42

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	21,673,383.07	5,177,750.09
5. 利息支出		366,107.88	160,441.75
其中：卖出回购金融资产支出		366,107.88	160,441.75
6. 税金及附加		0.21	516.23
7. 其他费用	6.4.7.20	108,524.44	116,626.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		620,665,860.83	195,372,112.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		620,665,860.83	195,372,112.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全精选混合型证券投资基金

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）	590,473,147.75	895,889,652.05	1,486,362,799.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	620,665,860.83	620,665,860.83
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）	520,248,912.05	935,802,940.86	1,456,051,852.91
其中：1.基金申购款	1,383,740,828.02	2,436,762,451.44	3,820,503,279.46
2.基金赎回款	-863,491,915.97	-1,500,959,510.58	-2,364,451,426.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,110,722,059.80	2,452,358,453.74	3,563,080,513.54
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)	502,625,895.53	276,350,215.31	778,976,110.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	195,372,112.71	195,372,112.71
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)	-44,777,741.12	-40,567,273.95	-85,345,015.07
其中：1.基金申购款	147,170,434.77	131,012,777.02	278,183,211.79
2.基金赎回款	-191,948,175.89	-171,580,050.97	-363,528,226.86
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)	457,848,154.41	431,155,054.07	889,003,208.48

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

兴全精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]522 号文《关于核准兴全保本混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于 2011 年 8 月 3 日正式生效,首次设立募集规模为 1,493,369,048.31 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人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,基金托管人为兴业银行股份有限公司,基金保证人为深圳市高新投集团有限公司。本基金于 2017 年 9 月 6 日起转型为兴全精选混合型证券投资基金。

根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金对持有人认购并持有到期的基金份额进行保本,未持有到保本周期到期日的份额持有人不适用本条款。在保本周期到期日,

如按基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上认购并持有到期的基金份额累计分控款项之和计算的总金额低于其认购保本金额，则基金管理人应补足该保本差额，并在保本周期到期日后 20 个工作日内将该保本差额支付给基金份额持有人，保证人对此提供不可撤销的连带责任担保。保本期间为三年，自本基金基金合同生效之日起至三年后的对应日止。保本周期届满时，在符合保本基金存续条件下，本基金将转入下一保本周期。如果保本周期到期后，本基金未能符合保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定，转型为非保本的兴全精选股票型证券投资基金，基金投资、基金费率等相关内容也将根据基金合同约定做相应修改。

根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，兴全保本于 2014 年 9 月 5 日起进入第二个保本周期，2017 年 9 月 5 日为第二个保本周期到期日。由于兴全保本在第二个保本周期届满后不再符合保本基金存续条件，兴全保本转型为非保本的混合型基金，名称相应变更为“兴全精选混合型证券投资基金”，自 2017 年 9 月 6 日起《兴全精选混合型证券投资基金基金合同》及《兴全精选混合型证券投资基金托管协议》生效。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括投资于股票(包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券等)、货币市场工具、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

自 2017 年 9 月 6 日起，本基金的业绩比较基准由“3 年期银行定存税后收益率”变更为“80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证国债指数收益率”。

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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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、债券免营业税和增值税; 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; 上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

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

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

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	175,477,387.41
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	—
存款期限 3 个月-1 年	—
其他存款	—
合计：	175,477,387.41

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		2,514,673,725.59	3,232,093,413.21	717,419,687.62
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	222,536,780.00	220,980,000.00	-1,556,780.00
	合计	222,536,780.00	220,980,000.00	-1,556,780.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		2,737,210,505.59	3,453,073,413.21	715,862,907.62

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	9,633.86
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	2,988.99
应收债券利息	7,048,612.02
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	29,434.30
应收黄金合约拆借孳息	—
应收出借证券利息	—
其他	974.70
合计	7,091,643.87

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	5,146,773.79
银行间市场应付交易费用	1,305.37
合计	5,148,079.16

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	206,987.84
应付证券出借违约金	-
预提费用	87,021.48
合计	294,009.32

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	685,420,909.70	590,473,147.75
本期申购	1,606,250,382.88	1,383,740,828.02
本期赎回(以“-”号填列)	-1,002,344,809.59	-863,491,915.97
- 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	1,289,326,482.99	1,110,722,059.80

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	654,116,015.01	241,773,637.04	895,889,652.05
本期利润	80,649,506.18	540,016,354.65	620,665,860.83
本期基金份额交易产生的变动数	607,104,476.81	328,698,464.05	935,802,940.86
其中：基金申购款	1,582,620,361.62	854,142,089.82	2,436,762,451.44
基金赎回款	-975,515,884.81	-525,443,625.77	-1,500,959,510.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,341,869,998.00	1,110,488,455.74	2,452,358,453.74

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	976,543.84
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	104,910.40
其他	41,818.60
合计	1,123,272.84

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	7,817,822,685.50
减：卖出股票成本总额	7,709,318,464.49
买卖股票差价收入	108,504,221.01

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	-424,419.78
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	-424,419.78

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	104,334,041.05

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	100,738,940.00
减：应收利息总额	4,019,520.83
买卖债券差价收入	-424,419.78

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	7,515,093.26
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	7,515,093.26

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	540,016,354.65
——股票投资	541,609,910.45
——债券投资	-1,593,555.80
——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	540,016,354.65

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	8,464,173.33
转换费收入	261,110.11
合计	8,725,283.44

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	21,671,458.07
银行间市场交易费用	1,925.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	21,673,383.07

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	27,349.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费用	18,000.00
银行手续费	2,902.96
其他费用	600.00
合计	108,524.44

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、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	16,845,656,089.79	100.00%	3,876,395,938.53	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	237,485.75	100.00%	84,487,509.27	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	-	-	95,500,000.00	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	12,323,015.73	100.00%	5,146,773.79	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	2,835,310.52	100.00%	1,509,337.24	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	22,657,356.47	6,518,576.76
其中：支付销售机构的客户维护费	6,248,590.53	1,980,200.92

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,776,226.06	1,086,429.42

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2011 年 8 月 3 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	4,595,762.28	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	4,595,762.28	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3564%	—

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
兴业银行	175,477,387.41	976,543.84	42,959,686.14	302,042.08

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

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（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
300735	光弘科技	2020 年 4 月 23 日	2020 年 10 月 27 日	非公开流通受限	23.68	17.36	123,131	2,915,742.08	2,137,554.16	-
300735	光弘科技	2020 年 5 月 29 日	2020 年 10 月 27 日	非公开流通受限-转增	0.00	17.36	49,252	0.00	855,014.72	注 1
002773	康弘药业	2019 年 12 月 31 日	2020 年 7 月 1 日	大宗流通受限	33.46	49.60	100,000	3,346,000.00	4,960,000.00	-
603659	璞泰来	2020 年 1 月 13 日	2020 年 7 月 13 日	大宗流通受限	80.45	101.19	200,000	16,090,000.00	20,238,000.00	-
000938	紫光股份	2020 年 2 月 10 日	2020 年 8 月 10 日	大宗流通受限	33.76	41.89	390,000	13,166,400.00	16,337,100.00	-
000938	紫光股份	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 13 日	大宗流通受限	36.30	41.79	400,000	14,520,000.00	16,716,000.00	-
000938	紫光股份	2020 年 3 月 6 日	2020 年 9 月 7 日	大宗流通受限	43.56	41.45	800,000	34,848,000.00	33,160,000.00	-
000938	紫光股份	2020 年 3 月 10 日	2020 年 9 月 10 日	大宗流通受限	40.71	41.44	300,000	12,213,000.00	12,432,000.00	-
002212	南	2020	2020	大宗	23.29	25.73	560,000	13,042,400.00	14,408,800.00	-

	洋股份	年 2 月 21 日	年 8 月 21 日	流通受限						
002212	南洋股份	2020 年 2 月 24 日	2020 年 8 月 24 日	大宗流通受限	24.16	25.71	1,500,000	36,240,000.00	38,565,000.00	-
300454	深信服	2020 年 3 月 6 日	2020 年 9 月 7 日	大宗流通受限	178.40	197.03	200,000	35,680,000.00	39,406,000.00	-
300413	芒果超媒	2020 年 3 月 6 日	2020 年 9 月 7 日	大宗流通受限	43.46	62.14	300,000	13,038,000.00	18,642,000.00	-
300413	芒果超媒	2020 年 4 月 20 日	2020 年 10 月 20 日	大宗流通受限	39.93	61.20	250,000	9,982,500.00	15,300,000.00	-
002624	完美世界	2020 年 3 月 12 日	2020 年 9 月 14 日	大宗流通受限	39.78	55.57	300,000	11,934,000.00	16,671,000.00	-
000710	贝瑞基因	2020 年 4 月 10 日	2020 年 10 月 12 日	大宗流通受限	38.27	55.35	500,000	19,135,000.00	27,675,000.00	-
000710	贝瑞基因	2020 年 5 月 6 日	2020 年 11 月 6 日	大宗流通受限	39.97	54.68	250,000	9,992,500.00	13,670,000.00	-
002007	华兰生物	2020 年 5 月 21 日	2020 年 11 月 23 日	大宗流通受限	38.10	46.96	255,000	9,715,500.00	11,974,800.00	-
002007	华兰生物	2020 年 5 月 26 日	2020 年 11 月 26 日	大宗流通受限	38.71	46.68	250,000	9,677,500.00	11,670,000.00	-
688312	燕麦科技	2020 年 5 月 29 日	2020 年 12 月 8 日	新股流通受限	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-
688599	天	2020	2020	新股	8.16	13.91	102,459	836,065.44	1,425,204.69	-

	合光能	年 6 月 2 日	年 12 月 10 日	流通受限						
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	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2021 年 1 月 8 日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注 1： 本基金持有的非公开发行股票光弘科技，于 2020 年 5 月 29 日实施 2019 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 3 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 49,252.00 股。

注 2： 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

本基金本期末未持有临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

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
170209	17 国开 09	2020 年 7 月 1 日	100.46	520,000	52,239,200.00
合计				520,000	52,239,200.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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	-	215,715.80
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	215,715.80

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有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 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	175,477,387.41	-	-	-	-	-	175,477,387.41
结算备付金	7,380,081.77	-	-	-	-	-	7,380,081.77

存出保证金	2,406,562.62	-	-	-	-	-	2,406,562.62
交易性金融资产	-220,980,000.00	-	-	-	-	-3,232,093,413.21	3,453,073,413.21
应收证券清算款	-	-	-	-	-	96,345,649.25	96,345,649.25
应收利息	-	-	-	-	-	7,091,643.87	7,091,643.87
应收申购款	2,977,542.50	-	-	-	-	50,426,207.44	53,403,749.94
资产总计	188,241,574.30	220,980,000.00	-	-	-	-3,385,956,913.77	3,795,178,488.07
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	49,399,855.30	-	-	-	-	-	49,399,855.30
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,066,733.25	7,066,733.25
应付赎回款	-	-	-	-	-	165,236,883.92	165,236,883.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,241,901.72	4,241,901.72
应付托管费	-	-	-	-	-	706,983.60	706,983.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,148,079.16	5,148,079.16
应付利息	-	-	-	-	-	3,528.26	3,528.26
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	294,009.32	294,009.32
负债总计	49,399,855.30	-	-	-	-	182,698,119.23	232,097,974.53
利率敏感度缺口	138,841,719.00	220,980,000.00	-	-	-	-3,203,258,794.54	3,563,080,513.54
上年度末 2019	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

年 12 月 31 日							
资产							
银行存款	52,530,942.20	-	-	-	-	-	52,530,942.20
结算备付金	3,945,877.04	-	-	-	-	-	3,945,877.04
存出保证金	652,697.23	-	-	-	-	-	652,697.23
交易性金融资产	-	-100,560,000.00	-	-215,715.80	1,360,089,328.23	1,460,865,044.03	
应收利息	-	-	-	-	3,010,638.83	3,010,638.83	
应收申购款	1,127,271.00	-	-	-	9,150,471.16	10,277,742.16	
资产总计	58,256,787.47	-100,560,000.00	-	-215,715.80	1,372,250,438.22	1,531,282,941.49	
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	25,285,516.36	25,285,516.36	
应付赎回款	-	-	-	-	15,564,522.56	15,564,522.56	
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,772,165.15	1,772,165.15	
应付托管费	-	-	-	-	295,360.86	295,360.86	
应付交易费用	-	-	-	-	1,815,429.33	1,815,429.33	
应付税费	-	-	-	-	0.69	0.69	
其他负债	-	-	-	-	187,146.74	187,146.74	
负债总计	-	-	-	-	44,920,141.69	44,920,141.69	
利率敏感度缺口	58,256,787.47	-100,560,000.00	-	-215,715.80	1,327,330,296.53	1,486,362,799.80	

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%	-452,507.64	-283,279.53
	利率 -1%	454,375.85	284,884.47

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为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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	3,232,093,413.21	90.71	1,360,089,328.23	91.50
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	220,980,000.00	6.20	100,775,715.80	6.78
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	3,453,073,413.21	96.91	1,460,865,044.03	98.28

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%	518,201,707.58	176,609,214.82
	业绩比较基准-10%	-518,201,707.58	-176,609,214.82

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	3,232,093,413.21	85.16
	其中：股票	3,232,093,413.21	85.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	220,980,000.00	5.82
	其中：债券	220,980,000.00	5.82
	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	182,857,469.18	4.82
8	其他各项资产	159,247,605.68	4.20
9	合计	3,795,178,488.07	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	92,716,144.40	2.60
C	制造业	1,785,160,505.19	50.10
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	-	-
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	724,622,566.60	20.34
J	金融业	697,512.16	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	60,132,233.79	1.69
M	科学研究和技术服务业	56,410,040.00	1.58
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	50,444,782.50	1.42
Q	卫生和社会工作	319,561,296.65	8.97
R	文化、体育和娱乐业	142,335,565.60	3.99
S	综合	-	-
	合计	3,232,093,413.21	90.71

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	600570	恒生电子	1,879,064	202,375,192.80	5.68
2	300413	芒果超媒	2,212,478	142,335,565.60	3.99
3	300015	爱尔眼科	3,141,618	136,503,302.10	3.83
4	002460	赣锋锂业	2,480,822	132,897,634.54	3.73
5	002044	美年健康	7,453,235	107,401,116.35	3.01
6	002475	立讯精密	1,899,574	97,543,124.90	2.74
7	002050	三花智控	4,253,119	93,143,306.10	2.61
8	601899	紫金矿业	21,071,851	92,716,144.40	2.60
9	688111	金山办公	264,692	90,413,493.36	2.54
10	600309	万华化学	1,803,835	90,173,711.65	2.53
11	000938	紫光股份	1,890,000	78,645,100.00	2.21
12	603290	斯达半导	370,103	77,647,609.40	2.18
13	600763	通策医疗	453,660	75,656,878.20	2.12
14	300496	中科创达	942,896	73,263,019.20	2.06
15	601689	拓普集团	2,579,000	71,954,100.00	2.02
16	601012	隆基股份	1,663,250	67,744,172.50	1.90
17	002555	三七互娱	1,416,538	66,293,978.40	1.86
18	002821	凯莱英	263,448	64,017,864.00	1.80
19	300661	圣邦股份	205,823	62,786,306.15	1.76
20	601888	中国中免	390,393	60,132,233.79	1.69
21	300010	豆神教育	3,066,771	60,016,708.47	1.68
22	688023	安恒信息	185,794	57,205,972.60	1.61
23	300502	新易盛	877,165	55,366,654.80	1.55
24	300253	卫宁健康	2,318,420	53,184,554.80	1.49
25	002212	南洋股份	2,060,000	52,973,800.00	1.49

26	002607	中公教育	1,817,830	50,444,782.50	1.42
27	000100	TCL 科技	8,064,092	49,997,370.40	1.40
28	002773	康弘药业	1,000,000	49,600,000.00	1.39
29	600416	*ST 湘电	3,065,206	43,617,881.38	1.22
30	300207	欣旺达	2,207,608	41,723,791.20	1.17
31	000710	贝瑞基因	750,000	41,345,000.00	1.16
32	300454	深信服	200,000	39,406,000.00	1.11
33	002371	北方华创	229,900	39,292,209.00	1.10
34	603392	万泰生物	235,390	38,839,350.00	1.09
35	002912	中新赛克	235,948	38,598,733.32	1.08
36	002007	华兰生物	796,511	38,252,416.21	1.07
37	002049	紫光国微	514,380	37,421,145.00	1.05
38	600862	中航高科	2,203,682	37,286,299.44	1.05
39	603486	科沃斯	1,203,997	36,372,749.37	1.02
40	002920	德赛西威	584,541	35,849,899.53	1.01
41	603520	司太立	413,200	34,733,592.00	0.97
42	600600	青岛啤酒	453,480	34,691,220.00	0.97
43	000661	长春高新	79,000	34,388,700.00	0.97
44	603229	奥翔药业	605,322	31,476,744.00	0.88
45	603208	江山欧派	304,040	29,613,496.00	0.83
46	688019	安集科技	76,005	29,236,843.35	0.82
47	603605	珀莱雅	160,460	28,886,009.20	0.81
48	300792	壹网壹创	152,268	26,518,994.88	0.74
49	000625	长安汽车	2,121,263	23,333,893.00	0.65
50	002891	中宠股份	503,281	20,574,127.28	0.58
51	688363	华熙生物	139,095	20,572,150.50	0.58
52	603659	璞泰来	200,000	20,238,000.00	0.57
53	603899	晨光文具	363,500	19,847,100.00	0.56
54	688012	中微公司	79,323	17,396,327.13	0.49
55	601865	福莱特	896,100	16,846,680.00	0.47
56	002624	完美世界	300,000	16,671,000.00	0.47
57	300759	康龙化成	153,100	15,065,040.00	0.42
58	603986	兆易创新	56,558	13,342,597.78	0.37
59	300497	富祥药业	480,047	9,394,519.79	0.26
60	300735	光弘科技	172,383	2,992,568.88	0.08
61	688599	天合光能	102,459	1,425,204.69	0.04
62	688106	金宏气体	26,075	1,355,378.50	0.04
63	601077	渝农商行	147,778	697,512.16	0.02
64	688037	芯源微	3,028	384,858.80	0.01

65	688558	国盛智科	8,488	376,018.40	0.01
66	688312	燕麦科技	7,390	308,680.30	0.01
67	688004	博汇科技	2,500	249,875.00	0.01
68	688555	泽达易盛	3,004	234,312.00	0.01
69	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
70	300832	新产业	882	151,871.58	0.00
71	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
72	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
73	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
74	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
75	605166	聚合顺	1,641	26,009.85	0.00
76	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
77	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
78	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
79	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
80	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
81	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
82	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
83	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002460	赣锋锂业	284,356,647.05	19.13
2	603986	兆易创新	281,845,683.74	18.96
3	600309	万华化学	255,174,597.63	17.17
4	000938	紫光股份	203,178,181.54	13.67
5	002475	立讯精密	191,472,684.07	12.88
6	600570	恒生电子	180,726,930.35	12.16
7	300750	宁德时代	178,226,943.35	11.99
8	002044	美年健康	174,661,923.80	11.75
9	300253	卫宁健康	160,649,034.17	10.81
10	300496	中科创达	156,176,987.78	10.51
11	000625	长安汽车	142,543,322.41	9.59
12	002007	华兰生物	138,502,692.28	9.32

13	300454	深信服	135,378,904.36	9.11
14	600048	保利地产	134,253,178.72	9.03
15	601689	拓普集团	130,339,945.41	8.77
16	601899	紫金矿业	118,763,965.65	7.99
17	002271	东方雨虹	115,123,881.67	7.75
18	002371	北方华创	108,521,760.52	7.30
19	300760	迈瑞医疗	108,088,986.56	7.27
20	300015	爱尔眼科	101,992,905.27	6.86
21	300271	华宇软件	94,244,821.81	6.34
22	300792	壹网壹创	90,023,439.85	6.06
23	600622	光大嘉宝	85,219,853.00	5.73
24	300413	芒果超媒	84,768,056.38	5.70
25	002049	紫光国微	84,075,506.73	5.66
26	000063	中兴通讯	83,169,916.47	5.60
27	688158	优刻得	80,703,078.97	5.43
28	300682	朗新科技	79,776,912.10	5.37
29	601111	中国国航	78,601,844.35	5.29
30	000100	TCL 科技	77,118,243.30	5.19
31	600031	三一重工	76,890,517.30	5.17
32	002912	中新赛克	76,515,651.32	5.15
33	603290	斯达半导	76,110,388.79	5.12
34	600216	浙江医药	75,074,959.46	5.05
35	300326	凯利泰	74,458,820.00	5.01
36	603160	汇顶科技	74,157,081.72	4.99
37	601012	隆基股份	70,780,786.67	4.76
38	001914	招商积余	69,895,784.94	4.70
39	603208	江山欧派	68,952,960.92	4.64
40	688258	卓易信息	68,805,830.52	4.63
41	002624	完美世界	65,228,659.65	4.39
42	300661	圣邦股份	65,111,476.88	4.38
43	002212	南洋股份	64,764,877.00	4.36
44	300502	新易盛	64,479,373.29	4.34
45	688023	安恒信息	64,210,582.62	4.32
46	600036	招商银行	63,776,782.22	4.29
47	002555	三七互娱	58,959,522.27	3.97
48	002557	洽洽食品	57,927,076.93	3.90

49	600763	通策医疗	57,839,246.00	3.89
50	600862	中航高科	57,340,898.56	3.86
51	300010	豆神教育	55,628,411.86	3.74
52	002607	中公教育	55,267,777.60	3.72
53	601318	中国平安	55,029,378.75	3.70
54	300142	沃森生物	54,387,950.07	3.66
55	600580	卧龙电驱	53,796,216.90	3.62
56	600519	贵州茅台	53,257,039.16	3.58
57	002925	盈趣科技	53,030,011.83	3.57
58	002050	三花智控	51,979,904.72	3.50
59	300033	同花顺	50,890,736.00	3.42
60	300482	万孚生物	50,834,478.85	3.42
61	300379	东方通	50,816,786.19	3.42
62	600498	烽火通信	50,779,928.64	3.42
63	002123	梦网集团	49,163,749.00	3.31
64	600585	海螺水泥	49,017,177.59	3.30
65	300601	康泰生物	48,522,089.36	3.26
66	601888	中国中免	48,013,000.95	3.23
67	300014	亿纬锂能	45,768,058.61	3.08
68	300145	中金环境	45,241,064.74	3.04
69	600745	闻泰科技	44,948,777.70	3.02
70	603737	三棵树	43,367,390.00	2.92
71	000860	顺鑫农业	42,535,776.64	2.86
72	300207	欣旺达	41,916,966.34	2.82
73	000333	美的集团	41,254,721.08	2.78
74	603195	公牛集团	40,467,127.25	2.72
75	688111	金山办公	40,160,445.46	2.70
76	002821	凯莱英	39,794,901.84	2.68
77	603429	集友股份	39,544,445.76	2.66
78	002985	北摩高科	39,533,707.85	2.66
79	000661	长春高新	39,396,333.00	2.65
80	300347	泰格医药	39,139,040.00	2.63
81	300782	卓胜微	39,000,937.00	2.62
82	688086	紫晶存储	38,367,541.69	2.58
83	600079	人福医药	37,734,642.48	2.54
84	603501	韦尔股份	37,689,255.40	2.54

85	603392	万泰生物	37,122,358.80	2.50
86	600416	*ST 湘电	36,631,866.80	2.46
87	002158	汉钟精机	35,791,290.23	2.41
88	688396	华润微	35,349,316.00	2.38
89	300373	扬杰科技	35,305,854.07	2.38
90	603799	华友钴业	35,248,939.00	2.37
91	600406	国电南瑞	34,523,591.86	2.32
92	300598	诚迈科技	33,734,590.00	2.27
93	300659	中孚信息	33,371,400.20	2.25
94	000710	贝瑞基因	32,531,685.00	2.19
95	600600	青岛啤酒	32,263,313.42	2.17
96	600547	山东黄金	32,232,788.54	2.17
97	000002	万 科 A	31,846,661.00	2.14
98	000858	五 粮 液	31,728,981.68	2.13
99	688012	中微公司	31,632,046.06	2.13
100	603486	科沃斯	31,553,184.42	2.12
101	002507	涪陵榨菜	31,287,999.40	2.11
102	601857	中国石油	30,680,839.00	2.06
103	300740	御家汇	30,677,892.90	2.06
104	603520	司太立	30,504,066.40	2.05
105	688029	南微医学	30,030,222.51	2.02
106	603068	博通集成	29,974,108.35	2.02

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	603986	兆易创新	332,447,449.27	22.37
2	600309	万华化学	224,466,673.94	15.10
3	300750	宁德时代	199,808,230.18	13.44
4	002460	赣锋锂业	175,270,662.08	11.79
5	000625	长安汽车	155,721,471.13	10.48
6	000938	紫光股份	154,540,214.69	10.40
7	600048	保利地产	135,994,390.03	9.15
8	002475	立讯精密	132,904,363.46	8.94
9	300253	卫宁健康	122,614,790.46	8.25

10	300454	深信服	120,717,828.37	8.12
11	300496	中科创达	119,021,498.90	8.01
12	002271	东方雨虹	116,697,091.63	7.85
13	002007	华兰生物	114,153,111.39	7.68
14	300760	迈瑞医疗	113,003,937.69	7.60
15	002044	美年健康	99,651,354.94	6.70
16	300792	壹网壹创	99,341,325.70	6.68
17	300033	同花顺	95,461,598.96	6.42
18	600031	三一重工	93,784,409.46	6.31
19	600622	光大嘉宝	87,461,841.09	5.88
20	300271	华宇软件	86,956,742.18	5.85
21	300326	凯利泰	86,796,049.92	5.84
22	300782	卓胜微	76,565,402.09	5.15
23	688158	优刻得	74,581,964.29	5.02
24	002371	北方华创	73,745,072.50	4.96
25	603160	汇顶科技	73,172,946.46	4.92
26	600216	浙江医药	72,195,845.15	4.86
27	601111	中国国航	71,960,374.40	4.84
28	300682	朗新科技	69,593,047.51	4.68
29	001914	招商积余	68,328,061.98	4.60
30	601899	紫金矿业	67,478,252.20	4.54
31	600036	招商银行	65,319,702.38	4.39
32	002557	洽洽食品	63,923,522.14	4.30
33	002624	完美世界	63,827,347.37	4.29
34	601318	中国平安	63,129,520.45	4.25
35	000063	中兴通讯	61,675,862.65	4.15
36	601689	拓普集团	59,698,128.87	4.02
37	688029	南微医学	59,345,893.22	3.99
38	603501	韦尔股份	59,127,589.00	3.98
39	300142	沃森生物	57,748,761.98	3.89
40	603737	三棵树	55,943,178.35	3.76
41	002607	中公教育	55,762,905.49	3.75
42	600519	贵州茅台	55,734,207.00	3.75
43	000725	京东方 A	52,212,200.00	3.51
44	688258	卓易信息	51,303,185.41	3.45
45	600763	通策医疗	50,338,662.70	3.39
46	600745	闻泰科技	48,513,964.46	3.26
47	002049	紫光国微	48,303,871.17	3.25

48	600498	烽火通信	47,350,493.82	3.19
49	600585	海螺水泥	47,257,014.11	3.18
50	300379	东方通	47,228,426.41	3.18
51	688023	安恒信息	45,995,094.65	3.09
52	600570	恒生电子	45,841,988.64	3.08
53	300601	康泰生物	45,666,741.15	3.07
54	600580	卧龙电驱	45,426,972.40	3.06
55	002123	梦网集团	45,296,323.12	3.05
56	002925	盈趣科技	45,164,525.95	3.04
57	300482	万孚生物	45,131,851.02	3.04
58	600079	人福医药	44,526,460.34	3.00
59	002600	领益智造	44,524,098.67	3.00
60	002985	北摩高科	44,377,622.62	2.99
61	300347	泰格医药	42,854,475.20	2.88
62	600176	中国巨石	40,842,387.23	2.75
63	000333	美的集团	40,825,802.52	2.75
64	601012	隆基股份	40,367,540.86	2.72
65	603208	江山欧派	39,826,667.00	2.68
66	300014	亿纬锂能	38,993,246.05	2.62
67	603195	公牛集团	38,607,479.98	2.60
68	300661	圣邦股份	38,526,937.85	2.59
69	688086	紫晶存储	38,288,436.98	2.58
70	300145	中金环境	38,209,332.01	2.57
71	300595	欧普康视	37,836,660.67	2.55
72	002912	中新赛克	37,797,267.92	2.54
73	600862	中航高科	37,567,191.20	2.53
74	002008	大族激光	37,082,831.98	2.49
75	603799	华友钴业	36,981,471.21	2.49
76	600547	山东黄金	35,927,603.02	2.42
77	002507	涪陵榨菜	35,593,402.07	2.39
78	000860	顺鑫农业	34,234,893.04	2.30
79	688111	金山办公	34,154,121.84	2.30
80	603429	集友股份	33,858,475.70	2.28
81	300497	富祥药业	33,303,249.18	2.24
82	002916	深南电路	33,279,571.20	2.24
83	603605	珀莱雅	32,876,888.60	2.21
84	600030	中信证券	32,248,239.68	2.17
85	600406	国电南瑞	32,124,482.00	2.16

86	000100	TCL 科技	32,063,016.00	2.16
87	000858	五 粮 液	31,791,454.53	2.14
88	688126	沪硅产业	31,763,408.67	2.14
89	300373	扬杰科技	31,722,876.90	2.13
90	300598	诚迈科技	31,627,062.46	2.13
91	002508	老板电器	31,544,787.87	2.12
92	688396	华润微	31,041,735.07	2.09
93	300552	万集科技	30,857,461.20	2.08
94	000002	万 科 A	30,639,693.76	2.06
95	601857	中国石油	30,376,024.07	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	9,039,712,639.02
卖出股票收入（成交）总额	7,817,822,685.50

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	220,980,000.00	6.20
	其中：政策性金融债	220,980,000.00	6.20
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	220,980,000.00	6.20

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	1,800,000	180,828,000.00	5.08

2	150220	15 国开 20	400,000	40,152,000.00	1.13
---	--------	----------	---------	---------------	------

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 市场中性策略执行情况

本基金不属于中性策略基金，故此项不适用。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,406,562.62
2	应收证券清算款	96,345,649.25
3	应收股利	—
4	应收利息	7,091,643.87
5	应收申购款	53,403,749.94
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	159,247,605.68

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300413	芒果超媒	33,942,000.00	0.95	大宗流通受限

本基金本报告期末前十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

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
452, 094	2, 851. 90	152, 476, 156. 88	11. 83%	1, 136, 850, 326. 11	88. 17%

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	9, 853, 485. 07	0. 7642%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2011 年 8 月 3 日 ）基金份额总额	1, 493, 369, 048. 31
本报告期期初基金份额总额	685, 420, 909. 70
本报告期基金总申购份额	1, 606, 250, 382. 88
减：本报告期基金总赎回份额	1, 002, 344, 809. 59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1, 289, 326, 482. 99

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。
(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——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	16,845,656,089.79	100.00%	12,323,015.73	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	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	237,485.75	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

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	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	上海证券报、指定互联网站	2020 年 1 月 13 日
2	关于 2020 年春节假期延长至 2 月 2 日暨 2020 年 1 月 31 日相关业务安排的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 1 月 31 日
3	关于使用固有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 2 月 3 日
4	关于旗下部分基金投资华峰氨纶（002064）非公开发行股票的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 2 月 6 日
5	关于兴全精选混合型证券投资基金暂停接受二十万元以上申购、转换转入申请的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 2 月 27 日
6	关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下基金基金合同、托管协议的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 2 月 28 日
7	关于公司法定名称变更的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 3 月 19 日
8	关于增加东兴证券、国联证券、华安证券、九州证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 3 月 20 日
9	关于调整网上直销汇款交易优惠费率率的公告	上海证券报、指定互联网站	2020 年 3 月 26 日
10	关于在海通证券开通兴全轻资产	上海证券报、指定互	2020 年 3 月 26 日

	基金、兴全精选基金定投业务的公告	联网网站	
11	关于恢复接受兴全精选混合型证券投资基金二十万元以上申购和转换转入申请的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 4 月 16 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	上海证券报、指定互联网网站	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	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 5 月 21 日
14	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 5 月 22 日
15	关于变更直销中心银行账户信息的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 5 月 25 日
16	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 6 月 2 日
17	关于增加中信证券华南为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 6 月 10 日
18	关于增加国盛证券为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 6 月 19 日
19	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	上海证券报、指定互联网网站	2020 年 6 月 19 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全精选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全精选混合型证券投资基金更新招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日