兴全精选混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018年6月30日

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全精选混合
场内简称	-
基金主代码	163411
交易代码	163411
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年8月3日
报告期末基金份额总额	509,884,133.71份
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。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

注: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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-23,835,718.18
2.本期利润	-37,000,874.48
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0732
4.期末基金资产净值	798,923,065.95
5.期末基金份额净值	1.5669

注:1.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。

2.所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:申购赎回费、红利再投资、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 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.56%	1.37%	-7.53%	0.91%	2.97%	0.46%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

注:1.净值表现所取数据截至到2018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%×沪深300指数收益率+20%×中证国债指数收益率。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈宇	本基金基金经理	2017年9月6日	-	12年	理学硕士,历任兴业证券研究员、兴全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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全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,并根据相关要求对股票大宗交易流程进行梳理,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 公平交易专项说明

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,考察是否存在非公平的因素。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年二季度经济总体平稳,在开工生产方面环比有所提升,上游库存动销恢复了正常。随着资管新规的落地,宏观去杠杆向纵深推进,信用风险陆续暴露,对股市和债市均有所冲击。海外方面,"贸易战"热度逐渐升温,中美两国的贸易摩擦增加了宏观经济的不确定性,特别是中兴事件,一定程度影响了投资者信心。但长远看,无论是整席金融环境还是在危机中加强自主可控行业的发展都会有效提升我国的综合国力。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.5669元;本报告期基金份额净值增长率为-4.56%,业绩比较基准收益率为-7.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	702,434,896.70	83.00
	其中:股票	702,434,896.70	83.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,038,880.00	7.57
	其中:债券	64,038,880.00	7.57
	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	58,964,325.77	6.97
8	其他资产	20,903,981.25	2.47
9	合计	846,342,083.72	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	22,158,136.53	2.77
C	制造业	289,604,626.72	36.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,008,611.05	3.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,236,350.00	0.91
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	163,172,184.56	20.42
J	金融业	201,104.40	0.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	62,610,288.87	7.84
M	科学研究和技术服务业	15,863,006.60	1.99
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	87,187,441.63	10.91
R	文化、体育和娱乐业	29,311,920.20	3.67
S	综合	-	-
	合计	702,434,896.70	87.92

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600845	宝信软件	2,961,616	78,038,581.60	9.77
2	300015	爱尔眼科	1,332,007	43,010,506.03	5.38
3	601888	中国国旅	576,514	37,133,266.74	4.65
4	002614	奥佳华	1,745,875	36,122,153.75	4.52
5	002507	涪陵榨菜	1,300,745	33,403,131.60	4.18
6	600760	中航沈飞	819,832	29,546,745.28	3.70
7	600031	三一重工	2,881,034	25,842,874.98	3.23
8	002027	分众传媒	2,704,809	25,477,022.13	3.19
9	600011	华能国际	3,920,920	24,937,051.20	3.12
10	300251	光线传媒	2,429,190	24,729,154.20	3.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,152,000.00	5.03
	其中:政策性金融债	40,152,000.00	5.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,956,000.00	2.50
7	可转债(可交换债)	3,930,880.00	0.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,038,880.00	8.02

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开1701	400,000	40,152,000.00	5.03
2	101564047	15中玉城投MTN001	200,000	19,956,000.00	2.50
3	137001	15美亚EB	37,000	3,930,880.00	0.49

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	838,794.04
2	应收证券清算款	16,134,360.17
3	应收股利	-
4	应收利息	1,242,187.18
5	应收申购款	2,688,639.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,903,981.25

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	137001	15美亚EB	3,930,880.00	0.49

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002027	分众传媒	22,560,000.00	2.82	大宗交易购入流通受限

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	512,890,670.44
报告期期间基金总申购份额	86,014,794.64
减:报告期期间基金总赎回份额	89,021,331.37
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	509,884,133.71

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

注:买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额,卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金对本基金进行交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

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

2."赎回份额"包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

9.3 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。

兴全基金管理有限公司

2018年7月19日

兴全可转债混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

2018年6月30日

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全可转债混合
场内简称	-
基金主代码	340001
交易代码	340001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年5月11日
报告期末基金份额总额	3,083,925,636.75份
投资目标	在锁定投资组合下方风险的基础上,以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增益。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序,个券和个股选择采用自下而上的程序,并严格控制投资风险。在个券选择层面,积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购;选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础投资有着较高上涨预期的可转债进行投资,以有效规避市场风险,并充分分享股市上涨的收益;运用"兴全可转债评估体系",选择定价无偏的个券进行投资,实现低风险的获利。在个股选择层面,以"相对投资价值"判断为核心,选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端,收益水平处于市场中高端。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日-2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-4,754,537.98
2.本期利润	-135,408,601.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0450
4.期末基金资产净值	3,115,890,210.44
5.期末基金份额净值	1.0104

注:1.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。

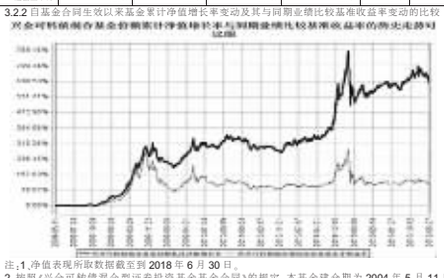
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.25%	0.60%	-6.13%	0.86%	1.88%	-0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:1.净值表现所取数据截至到2018年6月30日。

2.按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2004年5月11日至2004年11月10日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张亚辉	本基金基金经理	2015年7月13日	-	13年	工商管理硕士,历任兴业基金管理有限公司柔通经理、财务会计、固定收益交易员、专户投资部投资经理,兴全保本混合型证券投资基金(已转型为兴全精选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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全可转债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,并根据相关要求对股票大宗交易流程进行梳理,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 公平交易专项说明

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,考察是否存在非公平的因素。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来,国内外环境错综复杂,海外看,全球经济的复苏势头有所减弱,美联储继续加息,美国在全球范围内挥舞贸易"大刀",全球股市震荡,中美贸易摩擦仍有持续的趋势;国内经济增速也有放缓趋势,中美贸易摩擦加大了今年进出口的不确定性,而去杠杆的大背景下制约了投资的增速,政策层面上今年已经进行了两次定向降准,财政政策也有继续宽松的趋势,但政策的边际宽松或只能起到托底的作用,更多的是守住不发生系统性风险,而像之前那样大水漫灌、继续刺激经济很难再发生。报告期内股票市场出现了较大幅度的回撤,板块分化特征明显,以白酒、医药为代表的下游消费品公司表现较强,而与经济相关的上中游则出现了较大幅调整。转债市场也是回撤明显,先是受正股拖累大幅下跌,很多转债跌到面值附近,而今年在用事件预发,信用利差走阔,转债再次遭到信用下沉的影响出现回调,截止6月底,23左右的转债已经跌破面值,甚至有些转债已经跌破债底。今年以来利率债及高评级信用债表现较好,主要是对经济预期较悲观和避险的需求。

操作上,转债和股票保持中性仓位,很多股票和转债经过大幅调整后均出现了中长期配置的机会,等待时机并择机买入。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0104元;本报告期基金份额净值增长率为-4.25%,业绩比较基准收益率为-6.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	507,900,527.23	16.18
	其中:股票	507,900,527.23	16.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,313,025,637.95	73.68
	其中:债券	2,313,025,637.95	73.68
	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	210,000,000.00	6.69
	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	94,859,846.38	3.02
8	其他资产	13,388,567.20	0.43
9	合计	3,139,174,578.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	403,138,663.62	12.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,739,984.72	0.09
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	36,255,834.55	1.16
J	金融业	42,992,441.72	1.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,620,816.63	0.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	507,900,527.23	16.30

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	7,394,417	66,327,920.49	2.13
2	601233	桐昆股份	3,235,929	55,722,697.38	1.79
3	600309	万华化学	933,951	41,130,054.42	1.32
4	600845	宝信软件	1,375,933	36,255,834.55	1.16
5	600426	华鲁恒升	2,046,830	36,003,739.70	1.16
6	601318	中国平安	491,284	28,779,416.72	0.92
7	603589	口子窖	454,736	27,943,527.20	0.90
8	000596	古井贡酒	297,024	26,369,790.72	0.85
9	000951	中国重汽	1,968,402	26,160,062.58	0.84
10	600887	伊利股份	920,600	25,684,740.00	0.82

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,178,000.00	0.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	179,936,000.00	5.77
	其中:政策性金融债	179,936,000.00	5.77
4	企业债券	38,258,682.81	1.23
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,098,000.00	0.65
7	可转债(可交换债)	2,064,554,955.14	66.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,313,025,637.95	74.23

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132013	17宝武EB	2,510,310	251,407,546.50	8.07
2	123003	蓝思转债	1,261,200	116,623,164.00	3.74
3	128034	江银转债	959,480	89,797,733.20	2.88
4	113508	新风转债	905,570	88,329,297.80	2.83
5	123006	东材转债	726,672	87,396,841.44	2.80

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	710,128.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,129,752.22
5	应收申购款	3,548,686.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,388,567.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123003	蓝思转债	116,623,164.00	3.74
2	123006	东材转债	87,396,841.44	2.80
3	110041	蒙电转债	82,563,705.00	2.65
4	128020	水晶转债	70,044,901.85	2.25
5	110042	航电转债	62,030,088.00	1.99
6	113014	林洋转债	56,602,137.60	1.82
7	128015	久其转债	56,101,312.80	1.80
8	128016	雨虹转债	54,343,125.52	1.74
9	110040	生益转债	51,995,210.00	1.67
10	128032	双环转债	47,848,982.22	1.54
11	128019	久立转2	46,321,975.70	1.49
12	123004	铁汉转债	44,493,924.39	1.43
13	120001	16凤阳EB	37,923,128.88	1.22
14	128018	时达转债	37,729,678.48	1.21
15	113009	广汽转债	35,525,104.00	1.14
16	128023	亚太转债	35,522,841.70	1.14
17	128022	众信转债	26,570,580.61	0.85
18	128021	兄弟转债	25,409,331.30	0.82
19	113016	小康转债	19,160,400.00	0.61
20	113012	骆驼转债	16,382,773.50	0.53
21	127003	海印转债	488,775.75	0.02

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600309	万华化学	21,420,000.00	0.69	大宗流通受限

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,954,234,914.50
报告期期间基金总申购份额	354,540,102.85
减:报告期期间基金总赎回份额	224,849,380.60
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	3,083,925,636.75

注:买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额,卖出/赎回总份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.00

注:买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额,卖出/赎回总份额含转换转出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期未运用固有资金对本基金进行交易。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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