兴全磐稳增利债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:兴全基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月18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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全磐稳增利债券
场内简称	-
基金主代码	340009
交易代码	340009
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	2009年7月23日
报告期末基金份额总额	1,684,640,019.13份
投资目标	本基金在保证基金资产良好流动性的基础上,通过严格风险控制下的债券及其他证券产品投资,追求低风险下的稳定收益,并争取在基金资产保值的基础上,积极利用各种稳健的投资工具力争资产的持续增值。
投资策略	在严格的风险控制和确保基金资产流动性的前提下,在系统性分析研究的基础上,通过对债券类属配置和目标久期的适时调整,适时合理地利用现有的企业债券等投资工具,配合套利策略的积极运用,追求低风险下的稳健收益。
业绩比较基准	中证全债指数×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,预计长期平均风险与收益低于股票型、混合型以及可转债证券投资基金,高于货币市场基金。
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	5,849,636.71
2.本期利润	-33,248,829.84
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0174
4.期末基金资产净值	2,227,891,944.64
5.期末基金份额净值	1.3225

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 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	-14.4%	0.19%	0.61%	0.06%	-14.75%	0.13%

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2019年6月30日。

2、按照《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2009年7月23日至2010年1月22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		
张睿	固定收益部副总监,本基金、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、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理	2015年11月2日	-	14年	经济学硕士,历任红顶金融工程研究中心研究部经理,申银万国证券研究所高级分析师,兴全基金管理有限公司研究员、兴全货币市场基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理。

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、《兴全磐稳增利债券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 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

报告期内债券市场整体处于先跌后涨的震荡格局,期间经济基本面和事件性冲击不断扰动市场情绪。从基本面看,在财政前置和社融发力的情况下一季度经济压力减轻,但同时宏观杠杆率再度上升,四月份的中央政治局会议重提"去杠杆",货币政策重新出现边际收紧迹象,债券市场出现一波30BP左右的调整;但是财政前置和流动性推动的经济托底不具备大幅反弹的基础,二季度国内经济继续下行,而且5月份中美贸易谈判进程再度出现变化,双方进一步提升关税,使得债市收益率缓慢回落。从事件性影响看,5月底"包商银行被接管"事件一度引发市场恐慌,中小银行同业负债压力陡增,个别结构化账户也出现了一定风险,受该事件影响中低等级信用债需求有所减弱,评级利差有所拉大,不过期间央行通过不断释放流动性等各种措施稳定市场,整体看债市收益率在低位震荡。除上述两条主线外,通胀预期,美联储降息预期、海外债券利率下行等等对国内债市也有扰动。二季度在流动性宽松的资金面下,信用债表现依然好于利率债,但实质压力并未减轻,信用资质分层明显,本基金在信用资质的选择上保持谨慎。报告期内股票市场出现大幅调整,转债受此影响,估值和绝对价格均出现调整,配置价值再度显现。

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1.3225元;本报告期基金份额净值增长率为-1.14%,业绩比较基准收益率为0.61%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,854,320,995.58	96.93
	其中:债券	2,854,320,995.58	96.93
	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	35,832,196.34	1.22
8	其他资产	54,450,128.08	1.85
9	合计	2,944,603,320.00	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	384,512,000.00	17.26
	其中:政策性金融债	384,512,000.00	17.26
4	企业债券	827,574,700.00	37.15
5	企业短期融资券	161,069,000.00	7.23
6	中期票据	699,507,000.00	31.40
7	可转债(可交换债)	781,658,295.58	35.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,854,320,995.58	128.12

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	101560065	15中铝MTN003	1,300,000	132,145,000.00	5.93
2	180209	18国开09	1,200,000	120,036,000.00	5.39
3	101555025	15济南高新MTN002	1,000,000	101,770,000.00	4.57
4	180205	18国开05	900,000	96,759,000.00	4.34
5	180406	18农发06	900,000	95,310,000.00	4.28

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国债期货投资情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	90,868.67
2	应收证券清算款	2,285,245.30
3	应收股利	-
4	应收利息	51,132,605.99
5	应收申购款	941,408.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,450,128.08

5.10.4 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	113508	新凤转债	46,361,247.30	2.08
2	132006	16皖新EB	41,872,000.00	1.88
3	110045	海澜转债	37,610,770.80	1.69
4	113011	光大转债	33,604,000.00	1.51
5	113019	玖瑞转债	30,906,430.00	1.39
6	113013	国君转债	30,660,862.40	1.38
7	113517	曙光转债	25,984,497.00	1.17
8	110041	蒙电转债	21,622,507.50	0.97
9	132009	17中油EB	17,800,200.00	0.80
10	110047	山鹰转债	17,414,527.40	0.78
11	128048	张行转债	16,549,241.44	0.74
12	127005	长证转债	16,236,388.14	0.73
13	110040	生益转债	15,869,148.70	0.71
14	132014	18中化EB	15,022,962.00	0.67
15	132015	18中油EB	14,660,985.30	0.66
16	113017	吉视转债	13,998,600.00	0.63
17	110033	国贸转债	11,566,281.00	0.52
18	113519	长久转债	10,885,575.70	0.49
19	127006	敖东转债	9,590,635.45	0.43
20	113014	林洋转债	8,614,857.10	0.39
21	128021	兄弟转债	8,139,971.68	0.37
22	128028	赣锋转债	7,968,271.22	0.36
23	113020	桐昆转债	7,527,247.00	0.34
24	128032	双环转债	7,451,534.25	0.33
25	123009	星源转债	6,125,443.10	0.27
26	110048	福能转债	5,456,506.20	0.24
27	110046	圆通转债	4,390,796.20	0.20
28	128045	机电转债	2,359,840.00	0.11
29	113504	艾华转债	2,249,461.50	0.10
30	128010	顺昌转债	2,002,200.00	0.09
31	113012	骆驼转债	1,826,820.00	0.08

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.10.6 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	2,190,879,001.44
报告期间基金总申购份额	117,394,069.31
减:报告期期间基金总赎回份额	623,633,051.62
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	1,684,640,019.13

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
机构	1	2019年4月12日-6月30日	429,745,555.97	-	-		429,745,555.97	25.51%
个人	-	-	-	-	-		-	-
产品特有风险								
单一机构的集中大额赎回导致的流动性风险。考虑到单一机构占比大,集中赎回可能影响其他投资者的收益,制定投资策略时,管理人考虑到单一客户占比问题,因此组合久期较短,资产流动性较高,同时关注申赎动向,以便及时调整投资策略。								

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、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》

3、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金托管协议》

4、《兴全磐稳增利债券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
2019年7月19日

兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)

2019年第二季度报告

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:2019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2019年7月18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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全绿色投资混合(LOF)
场内简称	兴全绿色
基金主代码	163409
交易代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2011年5月6日
报告期末基金份额总额	287,916,635.19份
投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业成分,以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会,力争长期当期投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在大类资产配置上,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。在定期与不定期证券对各类资产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。在运用"绿色投资筛选策略"的基础上,采用环境因子与公司财务等基本面因子相结合,进行综合评估筛选,对那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证国债指数
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金,其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金,低于股票型基金,属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。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价值分风险。
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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	16,858,636.57
2.本期利润	1,056,489.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036
4.期末基金资产净值	467,434,510.13
5.期末基金份额净值	1.624

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。

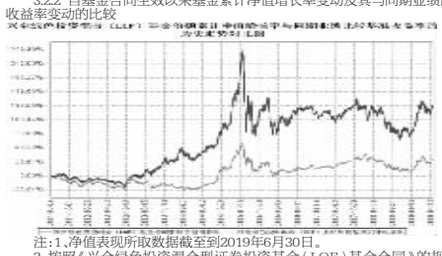
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	0.25%	1.45%	-0.87%	1.22%	1.12%	0.23%

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2019年6月30日。

2、按照《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为2011年5月6日至2011年8月5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		
邹欣	本基金基金经理	2017年6月29日	-	10年	金融学硕士,历任富国基金管理有限公司研究员,泰达宏利基金管理有限公司研究员,兴全基金管理有限公司研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理、研究部总监助理。

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、《兴全绿色投资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 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

今年2季度,A股整体震荡,创业板跌幅超过10%,市场风格极致抱团医药消费,白酒板块持续走强相对收益明显。

回顾2季度的操作,本基金从长期价值角度坚持组合结构,在提高研究深度的基础上降低换手率。面向未来一段时间宏观经济整体增速回落的环境,组合结构和精选个股更加重要,本基金将坚持结合好企业长短期价值调整结构,继续挖掘部分长期空间确定竞争结构稳定的公司,争取进一步贡献投资回报。

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1.624元;本报告期基金份额净值增长率为0.25%,业绩比较基准收益率为-0.87%。

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	421,194,427.23	88.46
	其中:股票	421,194,427.23	88.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	37,009,509.70	7.77
	其中:债券	37,009,509.70	7.77
	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	10,990,872.54	2.31
8	其他资产	6,945,663.91	1.46
9	合计	476,140,473.38	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	13,329,350.05	2.85
C	制造业	214,388,926.63	45.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	66,218.88	0.01
F	批发和零售业	28,288,377.34	6.05
G	交通运输、仓储和邮政业	10,345,676.28	2.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,495,261.74	6.31
J	金融业	47,439,789.93	10.15
K	房地产业	42,200,918.49	9.03
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	35,639,907.89	7.62
S	综合	-	-
	合计	421,194,427.23	90.11

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	603960	克来机电	1,573,377	42,937,458.33	9.19
2	601012	隆基股份	1,683,046	38,895,193.06	8.32
3	601318	中国平安	367,551	32,568,694.11	6.97
4	300413	芒果超媒	774,248	31,782,880.40	6.80
5	601933	永辉超市	2,770,654	28,288,377.34	6.05
6	600048	保利地产	2,210,232	28,202,560.32	6.03
7	000651	格力电器	466,900	25,679,500.00	5.49
8	002174	游族网络	1,216,800	20,539,584.00	4.39
9	601601	中国太保	406,388	14,837,225.88	3.17
10	603486	科沃斯	500,000	14,070,000.00	3.01

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	30,213,000.00	6.46
	其中:政策性金融债	30,213,000.00	6.46
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)	6,796,509.70	1.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,009,509.70	7.92

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	113008	电气转债	97,000	10,337,200.00	2.21
2	113021	中信转债	70,000	7,294,000.00	1.56
3	128036	文科转债	60,000	6,396,000.00	1.37
4	113009	广汽转债	50,000	5,335,000.00	1.14
5	113020	桐昆转债	40,000	4,304,000.00	0.92

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。

5.11.2 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	309,978.23
2	应收证券清算款	6,179,484.69
3	应收股利	-
4	应收利息	394,939.55
5	应收申购款	61,261.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,945,663.91

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	113020	桐昆转债	2,305,108.00	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	603486	科沃斯	14,070,000.00	3.01	大宗买入流通受限

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	304,428,850.60
报告期间基金总申购份额	8,933,611.09
减:报告期期间基金总赎回份额	25,445,826.50
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	287,916,635.19

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	4,765,967.59
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	4,765,967.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.66

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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》

3、《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)托管协议》

4、《兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

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
2019年7月19日

兴全货币市场证券投资基金

2019年第二季度报告

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:2019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2019年7月18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2019年4月1日起至6月30日