兴全货币市场证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月21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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全货币
场内简称	–
基金主代码	340005
交易代码	340005
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	2006年4月27日
报告期末基金份额总额	12,229,420,307.28份
投资目标	本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上,使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等,使基金收益达到同期货币市场的收益水平,力争超越业绩比较基准。
投资策略	本基金通过对货币市场短期金融工具的积极稳健投资,在风险和收益中寻找最优组合,在保持本金安全与资产充分流动性的前提下,综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资,追求稳定的现金收益。
业绩比较基准	税后6个月银行定期存款利率
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,其预期风险和预期收益率低于股票型、债券型和混合型基金。
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

§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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)
1. 本期已实现收益	96,698,780.13
2. 本期利润	96,698,780.13
3. 期末基金资产净值	12,229,420,307.28

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

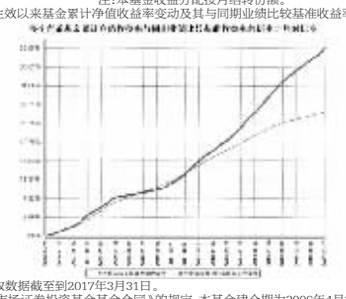
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9372%	0.0024%	0.3205%	0.0000%	0.6167%	0.0024%

注:本基金收益分配按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2017年3月31日。

2、按照《兴全货币市场证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2006年4月27日至2006年10月26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本基金投资组合的比例范围。

§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		
钟明	固定收益部总监助理兼本基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全稳益债券型证券投资基金和兴全天添益货币市场基金基金经理	2015年6月30日	–	12年	工商管理硕士,历任兴全基金管理有限公司基金会计、交易员、基金经理助理。
谢芝兰	本基金基金经理	2016年4月22日	–	5年	经济学硕士。历任信诚基金管理有限公司交易员,兴全基金管理有限公司研究员兼基金经理助理。

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、《兴全货币市场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。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的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。

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

2017年1季度宏观经济持续好转,pmi数据持续走高,以cpi为代表的通胀数据适中,企业盈利特别是上游原材料企业的盈利显著改善,中游企业的订单数据也有好转的迹象。虽然去年4季度出台了限购等房地产调控政策,但一季度的地产销量,特别是三四线城市的地产销售仍维持在高位,带动了家电家居等行业的终端销售,政府投资和基建也延续了去年的热度,整个一季度国内经济处在复苏和低通胀的良好格局中。

1季度,特别普新政落地的进度低于预期,全球的特朗普交易退潮,美元走弱,人民币贬值的压力减轻,外汇储备维持在稳定的水平。3月份流动性加息25个基点,中国央行随之上调了空开市场操作的利率10个基点,由于市场对加息的预期已经非常充分,所以没有引发市场的大幅波动。

1季度股市上涨,其中有盈利支撑的大盘蓝筹股跑赢中小创;在货币边际收紧的环境下,债市延续了去年4季度债灾的弱势局面;3月光大银行可转债发行成功,可转债终于迎来新增供给,对存量可转债估值有一定程度的冲击,可转债指数基本持平。

本基金降低了债券配置,增配了股票和可转债。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为0.9372%,同期业绩比较基准收益率为0.3205%。

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	固定收益投资	3,896,918,775.37	29.02
	其中:债券	3,896,918,775.37	29.02
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	2,092,601,178.90	15.58
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	7,342,391,325.63	54.68
4	其他资产	95,477,751.11	0.71
5	合计	13,427,389,031.01	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	5.45
	其中:买断式回购融资	–

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,159,547,540.67	9.48
	其中:买断式回购融资	–	–

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	30.18	9.48
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)–60天	5.82	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)–90天	45.09	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)–120天	5.99	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)–397天(含)	21.93	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	109.02	9.48

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	1,242,031,043.07	10.16
	其中:政策性金融债	1,242,031,043.07	10.16
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	259,734,123.42	2.12
6	中期票据	312,662,517.53	2.56
7	同业存单	2,082,491,091.35	17.03
8	其他	–	–
9	合计	3,896,918,775.37	31.87
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111710137	17兴业银行CD137	5,000,000	495,006,310.97	4.05
2	170401	17农发01	2,000,000	199,746,442.86	1.63
3	111793433	17长安银行CD023	2,000,000	198,278,224.84	1.62
4	111794770	17温州银行CD059	2,000,000	197,712,551.06	1.62
5	111794796	17杭州联合银行CD028	2,000,000	197,711,402.64	1.62
6	111790687	17河北银行CD003	2,000,000	197,193,177.28	1.61
7	111792173	17广州农村商业银行CD018	2,000,000	196,529,562.86	1.61
8	111792132	17广州农村商业银行CD017	2,000,000	196,497,735.99	1.61
9	111792653	17汉口银行CD019	2,000,000	196,133,671.86	1.60
10	120233	12国开33	1,700,000	170,034,084.39	1.39

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)–0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0473%
报告期内偏离度的最低值	–0.0172%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0198%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内本基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按照实际利率每日计提应收利息,2007年7月1日前按直线法,2007年7月1日起按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

5.9.2

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	82,469,372.18
4	应收申购款	13,008,378.93
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	95,477,751.11

5.9.4 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	3,836,615,449.01
报告期期间基金总申购份额	9,510,941,500.69
减:报告期期间基金总赎回份额	1,118,136,642.42
报告期期末基金份额总额	12,229,420,307.28

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交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年1月10日	114,731.87	114,731.87	–
2	红利再投	2017年2月10日	148,834.23	148,834.23	–
3	红利再投	2017年3月10日	135,873.60	135,873.60	–
合计			399,439.70	399,439.70	

注:"交易日期"为交易确认日或收益集中支付并自动结转为基金份额的日期。

§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	2017年1月1日–2017年3月31日	2,000,000.000	8,055,749,944.85	0.00		10,055,749,944.85	82.23
个人	–	–	–	–	–		–	–
产品特有风险								
由于单一机构占比高,如果出现集中大额赎回,对产品流动性冲击较大,且可能影响其他投资者的收益。投资策略上已尽力考虑到流动性需求,组合久期一直比较短,资产流动性较高,且同时关注申赎情况。								

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、《兴全货币市场证券投资基金基金合同》

3、《兴全货币市场证券投资基金托管协议》

4、《兴全货币市场证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

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
2017年4月21日

兴全可转债混合型证券投资基金

【2017】第一季度报告

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:2017年4月21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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31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	2,101,443,588.54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值。
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股票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"兴全可转债评价体系",选择定价失衡的个券进行投资,实现低风险的套利。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(2017年1月1日 – 2017年3月31日)
1.本期已实现收益	13,117,552.23
2.本期利润	–2,276,729.41
3.加权平均基金份额本期利润	–0.0011
4.期末基金资产净值	2,186,049,278.75
5.期末基金份额净值	1.0403

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。

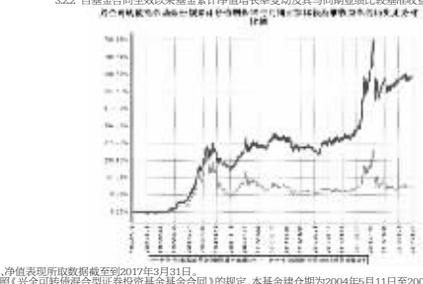
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	–0.11%	0.27%	0.73%	0.30%	–0.84%	–0.03%

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2017年3月31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、兴全保本混合型证券投资基金基金经理	2015年7月13日	–	12年	经济学学士。历任兴全基金管理有限公司渠道经理、财务会计、固定收益交易员、专户投资部投资经理。
陈宇	本基金基金经理	2015年8月25日	–	11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、兴全基金管理有限公司专户投资部投资经理。

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,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。公司监察稽核部对公司管理的不同投资组合的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。

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

2017年宏观经济一季度出现企稳态势,CPI环比温和下降,PPI呈现见顶的迹象,大宗商品也有掉头的信号。随着政府对于宏观经济企稳的底气增加,政府对于房地产的调控力度也在相应地加大,尤其是对于一线城市和部分二线城市。

经过过去两年资本市场一轮轮的洗礼,市场风格已经越来越倾向于追逐增长确定性高的低估值蓝筹股,越来越抛弃估值与成长性匹配不好的成长股。随着沪港通、深港通的进一步打通,市场风格也越来越趋向与国际标准接轨。我们认为,随着资本市场进一步开放,随着监管层注重加强对市场合规的管理,A股市场未来将走向更加成熟的发展方向。值得注意的是,监管层对于去杠杆的决心也是比较明显的。

绿色基金在第一季度降低了换手率,注重对原有持仓股票的深度跟踪,并且对新增加的股票都加大了研究和跟踪力度,风格上更加注重估值和成长性的匹配,以及对长远的成长空间多维度评判。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值增长率为–0.65%,同期业绩比较基准收益率为3.39%。

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	576,425,018.11	86.83
	其中:股票	576,425,018.11	86.83
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	40,077,000.00	6.04
	其中:债券	40,077,000.00	6.04
	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	10,555,385.89	1.59
8	其他资产	36,819,723.10	5.55
9	合计	663,877,127.10	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	300,500,859.80	45.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	63,632,201.12	9.66
E	建筑业	15,013,826.02	2.28
F	批发和零售业	47,987,713.24	7.28
G	交通运输、仓储和邮政业	17,369,314.89	2.64
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,500,042.15	1.59
J	金融业	12,460,000.00	1.89
K	房地产业	49,042,964.78	7.44
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
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	59,901,165.95	9.09
S	综合	–	–
	合计	576,425,018.11	87.50

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港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	300291	华录百纳	2,137,365	43,238,893.95	6.56
2	600079	人福医药	1,942,883	38,352,510.42	5.82
3	601199	江南水务	4,679,592	37,951,491.12	5.76
4	002450	康得新	1,844,200	35,261,104.00	5.35
5	300171	东富龙	2,516,200	33,440,298.00	5.08
6	300227	光韵达	1,299,975	29,886,425.25	4.54
7	000413	东旭光电	3,179,650	29,475,355.50	4.47
8	300054	鼎龙股份	1,378,672	28,428,216.64	4.32
9	600584	长电科技	1,499,984	28,319,697.92	4.30
10	600867	通化东宝	1,321,026	26,816,827.80	4.07

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	39,998,000.00	6.07
	其中:政策性金融债	39,998,000.00	6.07
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)	79,000.00	0.01
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	40,077,000.00	6.08

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	120223	12国开23	300,000	29,976,000.00	4.55
2	150201	15国开01	100,000	10,022,000.00	1.52
3	113012	骆驼转债	790	79,000.00	0.01

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	355,323.99
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	12,692,677.63
5	应收申购款	1,905,365.86
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	14,953,367.48

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	110032	三一转债	280,206,601.20	12.82
2	132004	15国盛EB	202,372,503.80	9.26
3	113009	广汽转债	100,417,331.00	4.59
4	113008	电气转债	73,968,830.40	3.38
5	110033	国贸转债	69,132,154.20	3.16
6	132005	15国资EB	62,234,605.20	2.85
7	123001	蓝标转债	28,706,144.88	1.31
8	128012	辉丰转债	25,690,614.24	1.18
9	128013	洪涛转债	24,745,822.10	1.13
10	113010	江南转债	19,966,962.40	0.91
11	132001	14宝钢EB	19,187,569.80	0.88
12	132003	15清控EB	10,861,137.30	0.50
13	127003	海印转债	8,585,005.05	0.39
14	110031	航信转债	4,914,180.00	0.22
15	117014	15大族01	3,681,000.00	0.17
16	128011	汽模转债	717,340.54	0.03

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	002594	比亚迪	25,097,556.96	1.15	非公开发行

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	2,029,909,628.82
报告期期间基金总申购份额	183,540,968.25
减:报告期期间基金总赎回份额	112,007,008.53
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	2,101,443,588.54

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	–	–	–	–	–		–	–
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。

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、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》

3、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》

4、《兴全可转债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
2017年4月21日

兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)

【2017】第一季度报告

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:2017年4月21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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§