兴全添利宝货币市场基金

2017年第三季度报告

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10月26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10月24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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全添利宝货币
场内简称	-
基金主代码	000575
交易代码	000575
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	2014年2月27日
报告期末基金份额总额	54,138,891,733.89份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下, 力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	根据宏观形势、利率走势等因素,确定各个阶段的投资组合平均久期,剩余期限等指标,并在这些指标要求的基础上构建投资组合;进行主动投资, 有效提高资产组合收益。本基金综合运用类属配置、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。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金, 属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金
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7月1日 - 2017年9月30日)
1. 本期已实现收益	571,841,780.75
2. 本期利润	571,841,780.75
3. 期末基金资产净值	54,138,891,733.89

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。

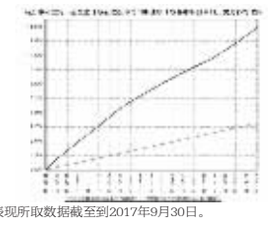
3.2 基金净值表现

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	1.0022%	0.0006%	0.3403%	0.0000%	0.6619%	0.0006%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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9月30日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2014年2月27日至2014年5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		
翟秀华	本基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理	2016年3月17日	-	7年	医学硕士,历任毕马威华振会计师事务所审计、泰信基金管理有限公司交易总监助理,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、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》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

随着中央金融工作会议的召开, 金融系统的稳定运行上升到了更为重要的层面,金融回归本源,加强服务实体经济的趋势将持续,对空转套利等行为的监管将久久为功。经济层面,三季度内,海外经济数据持续向好,联储加息、缩表仍有有条不紊的向前推进,欧洲经济回暖明显;国内方面,经济数据虽有放缓迹象,但仍信贷需求较好,大宗物价有所回升,整体上呈现较强韧性。货币政策上,央行保持了较强的定力,继续实施稳健中性的货币政策,并通过公开市场对短端利率进行"削峰填谷",实现精准调控,资金利率波幅增加,高位震荡,流动性风险有所降低。在货币政策的影响下,债券市场收益率曲线平坦化上行,走势较为平淡,绝对收益率保持在较高水平。对货币基金来说,较高的短端利率创造了良好的投资机会,实现了令持有人满意的回报。运作期内,本基金久期由短逐渐拉长,重点配置存款和存单类资产,积极预判市场节奏,主动调整大类资产配置比例,实现了超越基准的收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为1.0022%,业绩比较基准收益率为0.3403%。

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	32,895,722,226.04	52.43
	其中:债券	32,695,791,493.71	52.11
	资产支持证券	199,930,732.33	0.32
2	买入返售金融资产	9,081,895,802.85	14.48
	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	20,459,211,331.85	32.61
4	其他资产	301,609,497.59	0.48
5	合计	62,738,438,858.33	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		7.56
	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	5,931,028,362.67	10.96
	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资金余额超过基金资产净值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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	88

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过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	30.44	15.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.61	-
2	30天(含)-60天	11.09	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	21.73	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	6.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.17	-
5	120天(含)-397天(含)	45.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		115.33	15.83

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	3,037,432,467.65	5.61
	其中:政策性金融债	3,037,432,467.65	5.61
4	企业债券	40,931,736.49	0.08
5	企业短期融资券	4,694,422,290.59	8.67
6	中期票据	1,236,713,060.34	2.28
7	同业存单	23,686,291,938.64	43.75
8	其他	-	-
9	合计	32,695,791,493.71	60.39
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	420,655,499.72	0.78

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	150406	15农发06	5,900,000	590,116,370.60	1.09
2	111718272	17华夏银行CD272	5,500,000	541,869,932.42	1.00
3	170204	17国开04	5,200,000	518,255,609.54	0.96
4	150207	15国开07	5,070,000	508,207,670.80	0.94
5	111780796	17宁夏银行CD053	5,000,000	499,616,112.28	0.92
6	111710459	17兴业银行CD459	5,000,000	495,860,356.35	0.92
7	111710500	17兴业银行CD500	5,000,000	494,928,752.76	0.91
8	111780317	17广东南粤银行CD091	5,000,000	488,626,885.57	0.90
9	111785782	17郑州银行CD168	5,000,000	482,299,159.79	0.89
10	111785716	17重庆农村商行CD179	4,000,000	395,896,856.02	0.73

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	0.0743%
报告期内偏离度的最低值	0.0085%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0537%

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

序号	债券代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1789219	17惠益2A1	2,000,000	199,930,732.33	0.37

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(除特殊情况外),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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,141.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	301,599,355.79
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	301,609,497.59

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	47,340,580,467.03
报告期期间基金总申购份额	93,880,879,777.23
报告期期间基金总赎回份额	87,082,568,510.37
报告期期末基金份额总额	54,138,891,733.89

注:总申购份额含红利再投资。

§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	赎回	2017年7月3日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
2	赎回	2017年7月6日	-80,000,000.00	-80,000,000.00	-
3	赎回	2017年7月7日	-30,000,000.00	-30,000,000.00	-
4	赎回	2017年7月11日	-6,000,000.00	-6,000,000.00	-
5	赎回	2017年7月13日	-44,000,000.00	-44,000,000.00	-
6	赎回	2017年7月17日	-500,181,057.11	-500,181,057.11	-
7	赎回	2017年7月25日	-4,000,000.00	-4,000,000.00	-
8	申购	2017年7月28日	20,000,000.00	20,000,000.00	-
9	赎回	2017年7月31日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
10	红利再投资	2017年7月31日	1,189,934.41	1,189,934.41	-
11	申购	2017年8月3日	90,000,000.00	90,000,000.00	-
12	申购	2017年8月7日	7,000,000.00	7,000,000.00	-
13	赎回	2017年8月11日	-40,000,000.00	-40,000,000.00	-
14	赎回	2017年8月15日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
15	赎回	2017年8月24日	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
16	申购	2017年8月30日	10,000,000.00	10,000,000.00	-
17	赎回	2017年8月31日	-23,000,000.00	-23,000,000.00	-
18	红利再投资	2017年8月31日	259,322.66	259,322.66	-
19	申购	2017年9月6日	50,000,000.00	50,000,000.00	-
20	申购	2017年9月7日	19,000,000.00	19,000,000.00	-
21	赎回	2017年9月18日	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
22	赎回	2017年9月29日	-5,000,000.00	-5,000,000.00	-
23	红利再投资	2017年9月30日	270,938.39	270,938.39	-
合计			-614,460,861.65	-614,460,861.65	

注:1、"交易日期"为交易确认日或分红权益登记日。

2、因本基金收益分配按日结转份额,上表中"红利再投资"数据为当月汇总数据。

§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、中国证监会准予兴全添利宝货币市场基金募集注册的文件

2、关于募集兴全添利宝货币市场基金之法律意见书

3、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

4、基金托管人业务资格批件和营业执照

5、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》

6、《兴全添利宝货币市场基金托管协议》

7、中国证监会规定的其他文件

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10月26日

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

2017年第三季度报告

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10月26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10月24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7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴全新视野定期开放混合型发起式
场内简称	-
基金主代码	001511
交易代码	001511
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式(本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。)
基金合同生效日	2015年7月1日
报告期末基金份额总额	6,343,445,869.40份
投资目标	本基金通过精选基本面良好,具有盈利能力和市场竞争力的公司,同时通过灵活应用多种绝对收益策略,寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势,合理配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例。本基金主要采用市场中性的投资策略,结合多种绝对收益策略,通过定量和定性相结合的方法精选个股,并运用股指期货实现套期保值,力争实现稳定的绝对回报。
业绩比较基准	年化收益率6%
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。
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7月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	101,531,828.76
2.本期利润	323,670,743.35
3.加权平均基金份额本期利润	0.0562
4.期末基金资产净值	7,579,859,918.44
5.期末基金份额净值	1.195

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。

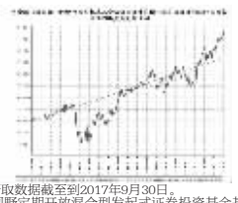
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	4.46%	0.45%	1.37%	0.01%	3.09%	0.44%

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9月30日。

2、按照《兴全新视野定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2015年7月1日至2015年12月31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。

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		
董承非	副总经理、基金管理部投资总监、本基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2015年7月1日	-	13年	理学硕士,历任兴全基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理、基金管理部副总监、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。

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、《兴全新视野定期开放混合型发起式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年三季度整体市场呈现震荡波动态势,二季度表现较好的白马成长股呈现高位震荡的局面,而偏周期类的行业在环保趋严带动产品价格较大幅度上涨的背景下出现了非常大的涨幅,而诸如人工智能、5G、国产芯片等科技类行业也因整体市场环境无忧带动了风险偏好的上升从而获得了较好的表现机会。本基金在三季度整体偏高仓位运行,对估值与成长性匹配度较好的标的进行稳定持有,享受并兑现了部分价值成长的收益,同时更换了部分标的,由于局限于投资风格与投资范围未对周期与主题科技类标的进行配置错过了一些机会。

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2.4351元;本报告期基金份额净值增长率为5.13%,业绩比较基准收益率为2.33%。

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	4,707,267,971.60	62.02
	其中:股票	4,707,267,971.60	62.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,808,575,030.06	23.83
	其中:债券	1,808,575,030.06	23.83
	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	485,961,528.94	6.40
	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	379,794,806.65	5.00
8	其他资产	207,956,674.86	2.74
9	合计	7,589,556,011.11	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	39,793.60	0.00
C	制造业	2,486,551,195.59	32.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	169,354,156.83	2.23
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	89,385,197.90	1.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	183,954,426.45	2.43
J	金融业	833,373,473.46	10.99
K	房地产业	7,756,064.50	0.10
L	租赁和商务服务业	502,571,452.71	6.63
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	115,299.99	0.00
R	文化、体育和娱乐业	434,110,245.22	5.73
S	综合	-	-
	合计	4,707,267,971.60	62.10

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	601318	中国平安	8,999,919	487,435,613.04	6.43
2	002027	分众传媒	36,542,316	367,250,275.80	4.85
3	601601	中国太保	9,367,394	345,937,860.42	4.56
4	600887	伊利股份	11,499,904	316,247,360.00	4.17
5	300144	宋城演艺	16,031,349	300,106,853.28	3.96
6	601100	恒立液压	13,768,961	250,457,400.59	3.30
7	000858	五粮液	4,167,533	238,716,290.24	3.15
8	600060	海信电器	14,081,052	221,323,296.92	2.92
9	600703	三安光电	9,438,508	218,407,075.12	2.88
10	600584	长电科技	10,427,442	180,394,746.60	2.38

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	1,542,990,000.00	20.36
	其中:政策性金融债	1,542,990,000.00	20.36
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)	265,585,030.06	3.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,808,575,030.06	23.86

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	170207	17国开07	5,000,000	498,450,000.00	6.58
2	110235	11国开35	4,000,000	401,240,000.00	5.29
3	110237	11国开37	4,000,000	395,400,000.00	5.22
4	170308	17进出08	1,200,000	119,856,000.00	1.58
5	080208	08国开08	1,000,000	100,540,000.00	1.33

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

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1710	IC1710	75	98,658,000.00	-327,960.00	套保
公允价值变动总额合计(元)					-327,960.00
股指期货投资本期收益(元)					1,542,280.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-327,960.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货套利策略寻找和发现市场中资产定价的偏差,捕捉绝对收益机会。

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	23,948,456.79
2	应收证券清算款	167,713,407.98
3	应收股利	-
4	应收利息	16,294,810.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	207,956,674.86

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	75,726,045.20	1.00
2	132006	16皖新EB	73,481,945.60	0.97
3	117009	15九洲债	40,344,000.00	0.53
4	117081	15名轩E2	23,303,062.76	0.31
5	137001	15英克EB	16,042,500.00	0.21
6	132004	15国盛EB	8,824,352.50	0.12

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	600584	长电科技	180,394,746.60	2.38	重大事项

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	4,712,936,479.37
报告期期间基金总申购份额	2,274,660,659.44
减:报告期期间基金总赎回份额	644,151,269.41
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	6,343,445,869.40

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	10,000,750.00
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	10,000,750.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.16

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投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,750.00	0.16	10,000,750.00	0.16	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	4,999,525.00	0.08	4,999,525.00	0.08	3年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	15,000,275.00	0.24	15,000,275.00	0.24	3年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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		