兴全社会责任混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018年8月28日

§1重要提示

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。本半年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月27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2018年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	兴全社会责任混合
场内简称	-
基金主代码	340007
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	2008年4月30日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,889,545,579.00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	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值，同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略，将定性与定量研究相结合，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。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展力强的行业的基础上，采用"兴全双层行业筛选法"进行优化调整。采用"兴全社会责任四维选股模型"精选股票。
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	较高风险、较高收益

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		兴全基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	田青
	联系电话	021-20398888	010-67595096
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099,021-38824536	010-67595096
传真		021-20398858	010-66275853

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

§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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	629,605,389.78
本期利润	-932,555,565.28
加权平均基金份额本期利润	-0.4596
本期基金份额净值增长率	-12.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	2.0880
期末基金资产净值	6,243,197,201.78
期末基金份额净值	3.304

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	-8.30%	1.83%	-6.03%	1.02%	-2.27%	0.81%
过去三个月	-12.68%	1.69%	-7.53%	0.91%	-5.15%	0.78%
过去六个月	-12.50%	1.66%	-9.52%	0.92%	-2.98%	0.74%
过去一年	3.48%	1.49%	-2.43%	0.76%	5.91%	0.73%
过去三年	14.05%	1.89%	-14.65%	1.18%	28.70%	0.71%
自基金合同生效起至今	276.49%	1.59%	9.80%	1.33%	266.69%	0.26%

注：本基金业绩比较基准为80%×沪深300指数+20%×中证国债指数，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债市场(包括银行间、上交所、深交所)的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。

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：

Return1=80%×（沪深300指数t/沪深300指数t-1-1)+20%×（中证国债指数t/中证国债指数t-1-1)

Benchmark1=(1+Return1)×（1+Benchmark1-1)-1

其中，t=1,2,3,…T,T表示时间截至日。

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

注：1.净值表现所取数据截至到2018年6月30日。

2.按照《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为2008年4月30日至2008年10月29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。

§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

兴全基金管理有限公司(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(AEGONInternational BV)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12亿元，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"兴业全球基金管理有限公司"，注册资本增加为15亿元人民币，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"。

截止2018年6月30日，公司旗下管理着二十二只基金，分别为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指数增强型证券投资基金(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、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
董承非	副总经理兼研究部总监、本基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、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基金经理	2018年6月22日	-	14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)基金经理助理、基金经理(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，兴全基金管理有限公司基金管理部投资总监。
董理	本基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理	2017年12月25日	-	10年	数学博士，历任国信智能有限公司技术部系统工程师、富安基金管理有限公司分析师、基金经理、华夏久盈资产管理有限公司投资经理。
傅鹏博	副总经理、研究部总监、本基金基金经理	2009年1月16日	2018年3月21日	25年	经济学硕士，历任上海财经大学经济管理系讲师、申银万国证券股份有限公司企业融资部经理、东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师、汇添富基金管理有限公司首席策略师、兴全基金管理有限公司基金管理部副总监、兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理、总经理助理、FOF投资与金融工程部总监。
朱璜	本基金基金经理助理	2017年2月7日	-	9年	工学硕士、工商管理硕士、金融工程硕士，历任上海太平洋化工集团研究院工程师、上海联合化学反应工程研究所高级研究员、英尼格投资发展有限公司分析师、富安达基金管理有限公司高级研究员，兴全基金管理有限公司研究部研究员。

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、《兴全社会责任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

"优选高景气行业、持有具备核心竞争力的公司，兼顾板块性价比"是2018年本基金投资主线。

分季度回顾运作如下：一季度，择机增加了化工、电气设备的股票，原有的电子类股票持仓有所增加；二季度，考虑到流动性、市场风险偏好降低等因素，适当减少了部分重仓股的绝对持有量。组合结构上，以电子、医药生物、化工、建筑建材的股票为主，增加了非银金融和银行的配置。

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3.304元；本报告期基金份额净值增长率为-12.50%，业绩比较基准收益率为-9.52%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济：国内经济下行，通胀压力减弱，社融继续大降。整体看，二季度PPI小幅反弹，CPI明显回落，物价继续走低。我们预计：PPI后续存在下降可能，但CPI将保持低位，后续通胀压力较弱。

国内政策从降杠杆到稳杠杆转变，积极的财政政策和适度的货币政策，对冲不确定的外部变化和贸易摩擦升温；政策调整，我们认为，"大水漫灌"式强刺激出现可能性小，政府会根据形势变化相机预调微调、定向调控，保持经济运行在合理区间，对证券市场而言，上半年"去杠杆、紧流动性、经济下行压力、贸易摩擦突发"等负面因素或有所减弱，有利因素在增加。

今年很多上市公司的股价承压，进入了一个估值压缩的周期，但是从历史对比来看，2018年的情况要远远优于金融危机爆发的2008年；彼时，A股市场面临的是估值偏高以及业绩增速下滑的双重压力，而今年的市场有些类似2011年，最坏情况就是业绩增速的下滑压力，但估值水平已经处于历史低位，但相对于2011年，在过往的几年间，中国经济的去产能已经取得了一定的成绩，上市公司的盈利能力出现较好的复苏状态，所以管理人对下半年的A股市场并不悲观。

基于以上判断，我们认为中国经济的韧性可能会超出现在市场的预期，但是最终的数据需要时间来验证。短期内市场过于悲观的情绪叠加，强化使得交投清淡，但是从中长期维度来看，A股市场目前正处于黎明前的黑暗时期，在经历短暂的阵痛之后，必然会享受中国经济发展的红利。

下半年，本基金将会继续更多的自下而上精选个股，坚持均衡配置的策略，虽然很难从行业、板块层面去判断投资机会，但更多的是从单个的上市公司自身出发，选择具备优秀管理团队的优质公司，在未来将会贡献更多的收益，我们要做的就是更为细致地研究与跟踪，发现并持有这些优质公司。

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给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有3年以上相关工作经历，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》、《兴全社会责任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，本报告期内未进行利润分配，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遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本半年度报告中的财务指标、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。

§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：兴全社会责任混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款		637,529,234.50	123,759,610.61
结算备付金		917,723.27	13,944,796.88
存出保证金		1,212,625.00	1,533,070.02
交易性金融资产		5,619,676,988.82	8,500,578,088.44
其中：股票投资		5,297,610,150.26	8,022,166,088.44
基金投资		-	-
债券投资		322,066,838.56	478,412,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	34,907,058.56
应收利息		8,321,665.75	11,163,460.06
应收股利		-	-
应收申购款		10,984,249.58	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		6,278,642,486.92	8,685,886,084.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		91,166.70	9,116,975.07
应付赎回款		24,737,731.27	26,652,242.60
应付管理人报酬		8,274,931.33	11,357,239.13
应付托管费		1,379,155.21	1,892,873.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		699,372.39	4,642,724.83
应交税费		18.49	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		262,909.75	451,068.07
负债合计		35,445,285.14	54,113,122.89
所有者权益：			
实收基金		1,889,545,579.00	2,285,684,691.17
未分配利润		4,353,651,622.78	6,346,088,270.51
所有者权益合计		6,243,197,201.78	8,631,772,961.68
负债和所有者权益总计		6,278,642,486.92	8,685,886,084.57

注：报告截止日2018年6月30日，基金份额净值3.304元，基金份额总额1,889,545,579.00份。

6.2利润表

会计主体：兴全社会责任混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-860,775,118.74	1,139,594,185.70
1.利息收入		7,208,369.24	4,768,369.41
其中：存款利息收入		782,676.39	635,480.43
债券利息收入		6,425,692.85	4,021,873.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	111,015.29
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）		691,851,642.60	239,422,082.81
其中：股票投资收益		644,869,722.02	215,011,939.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-71,720.00	-761,500.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		47,053,640.58	25,171,642.88
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）		-1,562,160,955.06	894,319,552.01
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）		2,325,824.48	1,084,181.47
减：二、费用		71,780,446.54	63,261,564.35
1. 管理人报酬		55,228,531.89	43,265,765.35
2. 托管费		9,204,755.26	7,210,960.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		7,131,630.73	12,576,994.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		6.69	-
7. 其他费用		215,521.97	207,844.04
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-932,555,565.28	1,076,332,621.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-932,555,565.28	1,076,332,621.35

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：兴全社会责任混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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）	2,285,684,691.17	6,346,088,270.51	8,631,772,961.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-932,555,565.28	-932,555,565.28
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）	-396,139,112.17	-1,059,881,082.45	-1,456,020,194.62
其中：1.基金申购款	477,060,077.25	1,296,398,606.94	1,773,458,684.19
2.基金赎回款	-873,199,189.42	-2,356,279,689.39	-3,229,478,878.81
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）	1,889,545,579.00	4,353,651,622.78	6,243,197,201.78
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	2,145,200,024.22	3,589,027,601.96	5,734,227,626.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	1,076,332,621.35	1,076,332,621.35
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）	-87,072,397.45	-151,549,277.40	-238,621,674.85
其中：1.基金申购款	382,587,068.92	719,353,504.17	1,101,940,573.09
2.基金赎回款	-469,659,466.37	-870,902,781.57	-1,340,562,247.94
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）	2,058,127,626.77	4,513,810,945.91	6,571,938,572.68

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 俞鸿飞

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

兴全社会责任混合型证券投资基金(原名"兴业社会责任股票型证券投资基金")(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于核准兴业社会责任股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2008]356号文)的核准，由兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2008年4月30日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为1,888,696,479.84份基金份额。根据《兴全基金管理有限公司关于旗下部分基金更名的公告》，自2015年8月7日起，"兴业社会责任股票型证券投资基金"更名为"兴全社会责任混合型证券投资基金"。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全社会责任混合型证券投资基金基金合同》和《兴全社会责任混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券及其他中国证监会批准的投资工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票资产65%-95%，债券资产0%-30%，资产支持证券占0%-20%，权证投资比例0%-3%，现金或者到期日在一年内的政府债券不小于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的80%。

本基金的业绩比较基准为：80%×沪深300指数+20%×中证国债指数。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度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

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会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[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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税应纳税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《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]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营基金过程中发生的增值税应税行为，以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。对基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者(包括单位和个人)通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2008年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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；持股期限超过1年的，股权登记日为自2008年1月1日起至2015年9月7日期间的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日及以后的，暂免征收个人所得税。

(e)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照10%的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(g)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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
兴全基金管理有限公司(以下简称"兴全基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")	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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	100,228,448.32	1.97%	598,065,572.77	6.31%

6.4.8.1.2债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	2,880,200.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.3债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.8.1.4权证交易

本基金本报告期内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。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	73,804.22	2.28%	47,906.22	6.85%
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
关联方名称	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	441,453.84	6.55%	308,980.22	7.29%

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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,228,531.89	43,265,765.35
其中：支付销售机构的客户维护费	11,313,311.19	7,234,044.83

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,204,755.26	7,210,960.88

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。

6.4.8.2.3销售服务费

无。

6.4.8.3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。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人均无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.8.4.2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和上年度末均未投资本基金。

6.4.8.5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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
建设银行	637,529,234.50	733,365.68	197,228,723.56	572,197.79

6.4.8.6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。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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

6.4.9.1.1 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	流通受限类别	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