

# 兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金（FOF） 2019 年半年度报告

2019 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 23 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 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 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贵金属投资明细.....	51
7.9 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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 本报告期投资基金情况.....	52
7.13 投资组合报告附注.....	55
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	56
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件.....	58
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58

10.9 其他重大事件.....	58
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>60</b>
11.1 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.....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	兴全安泰平衡养老三年持有 FOF
场内简称	-
基金主代码	006580
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	2019 年 1 月 25 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	695,499,836.57 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	在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 年（3 年指 365 天乘以 3 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路368号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼28-30楼	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		201204	518040
法定代表人		兰荣	李建红

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴全基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28-30楼

### § 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(2019年1月25日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	22,474,091.20
本期利润	65,283,460.90
加权平均基金份额本期利润	0.0984
本期加权平均净值利润率	9.10%
本期基金份额净值增长率	10.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	23,508,291.95
期末可供分配基金份额利润	0.0338
期末基金资产净值	766,914,531.92
期末基金份额净值	1.1027
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.27%

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。

4、本基金成立于2019年1月25日。

#### 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	2.34%	0.60%	2.63%	0.57%	-0.29%	0.03%
过去三个月	-0.66%	0.76%	-0.48%	0.72%	-0.18%	0.04%
自基金合同生效起至今	10.27%	0.78%	10.31%	0.74%	-0.04%	0.04%

注：1、本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：中证偏股型基金指数选取内地市场所有股



票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数。

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：

$$\text{Return } t = 50\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率 } t / \text{中证偏股型基金指数收益率 } t-1 - 1) + 50\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率 } t / \text{中债综合（全价）指数收益率 } t-1 - 1)$$

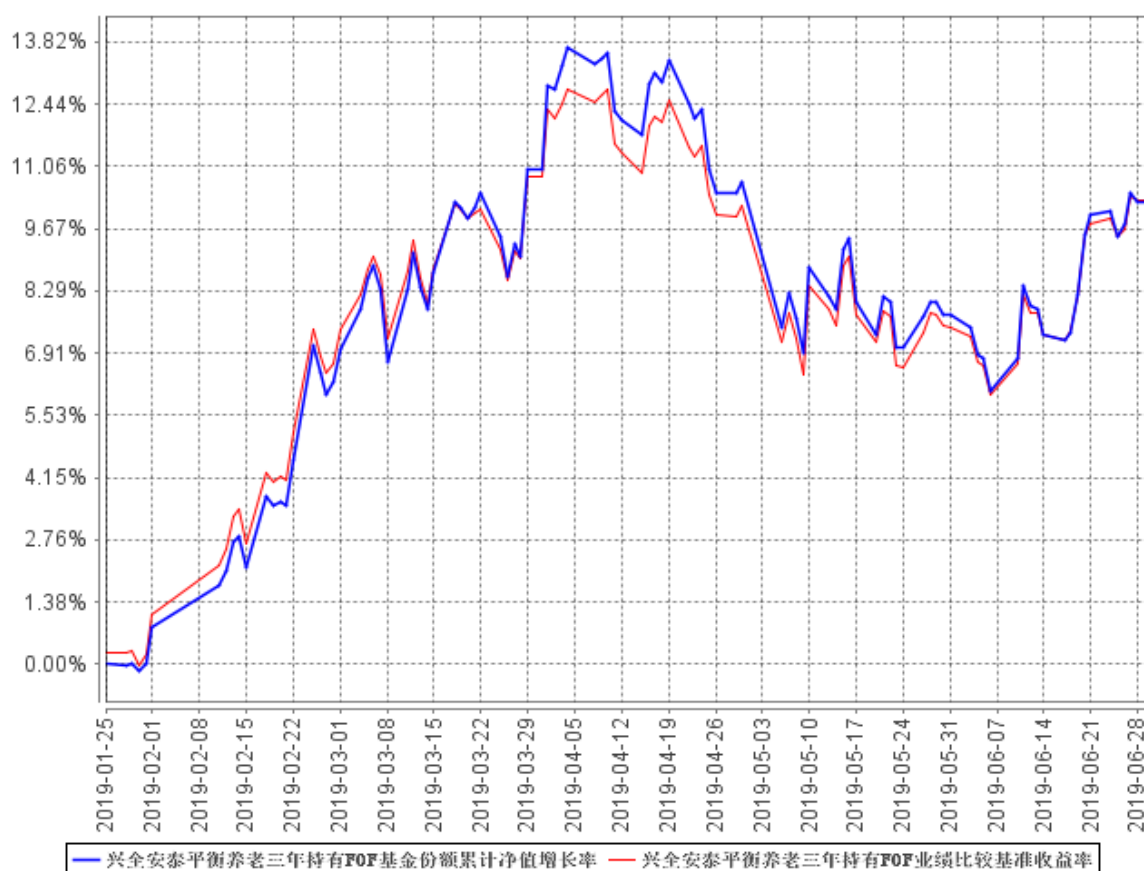
$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日。

2、本基金成立于2019年1月25日，截至2019年6月30日，本基金成立不满一年。

### 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

兴全安泰平衡养老三年持有FOF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到2019年6月30日。

2、按照《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，

本基金应自 2019 年 1 月 25 日成立起六个月内，达到本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围，目前本基金还在建仓期内。

3、本基金成立于 2019 年 1 月 25 日，截至 2019 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

### **3.3 其他指标**

无。

## § 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（AEGON International B.V）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 1.2 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 1.5 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 2019 年 6 月 30 日，公司旗下管理着 26 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期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、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（LOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林国怀	FOF 投资与金融工程部、养老金	2019 年 1 月 25 日	-	10 年	经济学硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资

	管理部 总监，本 基金基 金经理				产管理中心基金组合投资 经理，泰康资产管理有限 公司执行总监，天安人寿 资产管理中心权益投资部 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、《兴全安泰平衡目标养老三年持有期混合型基金中基金（FOF）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 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、考察是否存在不公平的因素。

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

上半年上证指数上涨 19.45%，沪深 300 指数上涨 27.07%，中证 500 指数上涨 18.77%；从行业上来看，以食品饮料、非银、农业以及家电等行业表现领先，而钢铁、传媒、汽车等行业表现相对落后。

本基金 2019 年 1 月 25 日成立，鉴于当时较低的估值水平和悲观的市场情绪，我们采取了相对积极的建仓策略。资产配置层面，本基金的资产配置中枢为 50%的权益类资产和 50%的固定收益类资产，在权益资产部分，主要以配置股票型和混合型基金为主，辅以较小比例的股票配置；在固定收益资产部分，主要以配置纯债型基金为主，并适当参与可转债以及可转债基金。

权益资产部分，一季度随着股票市场的快速上涨，市场已经从低估状态回到正常水平，组合在此过程中进行了再平衡，减持前期表现相对优异且略偏高估的品种；二季度在宏观经济数据相对偏弱、中美贸易摩擦等诸多因素影响下，市场出现了一定程度的调整，在此过程中组合提升了性价比相对较好的品种的占比；5 月中旬以来，随着科技股、中小市值股票相对于消费股、大盘股的表现落后，组合逐步提升了以科技股和中小市值板块为重仓的基金品种的占比。

固收资产主要配置于纯债基金，鉴于上半年整体较低的债券收益率，配置上以中短久期的债券型基金为主；此外，因为近年来可转债市场迎来了前所未有的大扩容，投资价值非常显著，所以组合中也加大了对于可转债品种以及可转债基金的配置比例。

总的来看，上半年组合的操作风格符合一贯的投资思路，资产配置上以战略型资产配置为主，辅以再平衡、性价比比较等方式进行适度的战术型调整；品种上以基金配置为主，辅以股票、债券（含可转债）等品种从而把握多种资产的投资机会；组合配置上以均衡配置为主，辅以适度的左侧交易进行提前布局。

#### 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 1.1027 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.27%，业绩比较基准收益率为 10.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内的宏观经济具有较强的韧性，向下的空间相对有限，加上全球货币政策整体处于偏宽松的状态，所以对未来市场的宏观环境相对正面；从估值的角度来看，目前沪深 300 估值 12 倍，中证 500 估值 22 倍，从历史情况来看都处于相对偏低的水平，从 FED 模型来看，目前股票市场相对于债券市场的吸引力更高。基于以上分析，对于下半年的股票市场整体偏乐观。

目前，国内各项改革和开放也在不断的推进，中美之间的谈判仍在进行时，在此过程中可能会对市场有一定程度的扰动，我们对中国资本市场的前景充满信心。

#### 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》、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2019年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	19,541,114.02
结算备付金		316,026.57
存出保证金		58,091.02
交易性金融资产	6.4.7.2	750,036,143.05
其中：股票投资		32,021,865.71
基金投资		624,379,679.70
债券投资		93,634,597.64
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	567,893.69
应收股利		-
应收申购款		160,745.23
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		770,680,013.58
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		3,304,642.86
应付赎回款		-
应付管理人报酬		260,431.83
应付托管费		88,378.59
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	20,792.25
应交税费		15,268.54



应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	75,967.59
负债合计		3,765,481.66
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	695,499,836.57
未分配利润	6.4.7.10	71,414,695.35
所有者权益合计		766,914,531.92
负债和所有者权益总计		770,680,013.58

注：1、报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.1027元，基金份额总额695,499,836.57份。

2、本基金合同于2019年1月25日生效，本期财务报表的实际编制期间为自2019年1月25日（基金合同生效日）起至2019年6月30日止。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型证券投资基金（FOF）

本报告期：2019年1月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
<b>一、收入</b>		67,547,749.27
1.利息收入		914,794.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	133,965.52
债券利息收入		442,133.31
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		338,695.80
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		23,823,584.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,923,632.17
基金投资收益		12,075,023.96
债券投资收益	6.4.7.13	3,987,249.23
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	4,837,679.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	42,809,369.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-

<b>减：二、费用</b>		2,264,288.37
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,340,944.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	440,717.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	382,452.83
5. 利息支出		1,172.30
其中：卖出回购金融资产支出		1,172.30
6. 税金及附加		8,583.33
7. 其他费用	6.4.7.20	90,417.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		65,283,460.90
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		65,283,460.90

注：本基金合同于2019年1月25日生效，本期数据按实际存续期计算。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2019年1月25日（基金合同生效日）至2019年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日（基金合同生效日）至2019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）	628,976,962.65	-	628,976,962.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,283,460.90	65,283,460.90
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）	66,522,873.92	6,131,234.45	72,654,108.37
其中：1. 基金申购款	66,522,873.92	6,131,234.45	72,654,108.37
2. 基金赎回款	-	-	-
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	695,499,836.57	71,414,695.35	766,914,531.92

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效，本期数据按实际存续期计算。

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：

<u>          兰荣          </u>	<u>          庄园芳          </u>	<u>          詹鸿飞          </u>
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

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）系由基金管理人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》、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2018]1665 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集基金份额为 628,976,962.65 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(19)第 00052 号验资报告。基金合同于 2019 年 1 月 25 日正式生效。本基金的管理人为兴全基金管理有限公司，托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金的权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2019 年 1 月 25 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括基金投资、股票投资和债券投资。

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的基金、股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当

确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 基金投资

买入基金于交易日确认为基金投资，基金投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出基金于交易日确认基金投资收益，卖出基金的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### (2) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### (3) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法确认债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (4) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对于基金投资，按如下方法估值：(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；(d) 对于境内非上市货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况的，按以下原则进行估值：(a) 以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。(b) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。(c) 若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(4) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变

化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(5) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

(5) 基金投资收益/（损失）于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账。

(6) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

(7) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

(8) 衍生工具收益/（损失）于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率逐日计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收



益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。

(2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(3) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(4) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、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[2012]85 号《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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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《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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免营业税和增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金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。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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; 上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4)对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	19,541,114.02
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	19,541,114.02

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	31,154,364.35	32,021,865.71	867,501.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	53,630,597.64	-1,295,675.62
	银行间市场	40,004,000.00	-17,140.00
	合计	93,634,597.64	-1,312,815.62
资产支持证券	-	-	-
基金	581,124,995.74	624,379,679.70	43,254,683.96
其他	-	-	-
合计	707,226,773.35	750,036,143.05	42,809,369.70

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	3,144.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	142.20
应收债券利息	564,581.25
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	26.20
合计	567,893.69

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	20,657.30
银行间市场应付交易费用	134.95
合计	20,792.25

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	75,967.59
合计	75,967.59

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	628,976,962.65	628,976,962.65
本期申购	66,522,873.92	66,522,873.92
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	695,499,836.57	695,499,836.57

注：买入/申购总份额含红利再投资份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	22,474,091.20	42,809,369.70	65,283,460.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,034,200.75	5,097,033.70	6,131,234.45
其中：基金申购款	1,034,200.75	5,097,033.70	6,131,234.45
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,508,291.95	47,906,403.40	71,414,695.35

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日

活期存款利息收入	122,984.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,681.41
其他	1,299.93
合计	133,965.52

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
卖出股票成交总额	15,522,780.61
减：卖出股票成本总额	12,599,148.44
买卖股票差价收入	2,923,632.17

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30 日
卖出/赎回基金成交总额	143,988,602.98
减：卖出/赎回基金成本总额	131,913,579.02
基金投资收益	12,075,023.96

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,987,249.23

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,987,249.23

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	44,446,338.22
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,419,485.26
减：应收利息总额	39,603.73
买卖债券差价收入	3,987,249.23

#### 6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6 月30日
股票投资产生的股利收益	722,251.43
基金投资产生的股利收益	4,115,428.15
合计	4,837,679.58

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	42,809,369.70
——股票投资	867,501.36
——债券投资	-1,312,815.62
——资产支持证券投资	-
——基金投资	43,254,683.96
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	42,809,369.70

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
交易所市场交易费用	71,524.59
银行间市场交易费用	400.00
交易基金产生的费用	310,528.24
其中：申购费	30,100.00
赎回费	212,374.48
交易费	5,419.73
转换费	62,634.03
合计	382,452.83



#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019 年6月30日
审计费用	20,717.72
信息披露费	55,249.87
账户维护费用	1,500.00
证券账户开户费	400.00
银行费用	12,550.10
合计	90,417.69

#### 6.4.7.21.1 持有基金产生的费用

单位：人民币元

项目	本期费用 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月 30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	27,824.39
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,375,476.34
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	470,510.27

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

#### 6.4.7.22 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须做披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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，基金销售机构，基金注册登记机构
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日) 至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	57,335,949.44	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	125,897,342.28	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至 2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
兴业证券	1,039,000,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019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	49,479.53	100.00%	20,657.30	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,340,944.45	-
其中：支付销售机构的客户维护费	704,105.32	-

注：基金管理费按前一日基金资产净值的0.50%的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人

所管理的基金的部分不收取管理费。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值扣除本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分×0.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效 日)至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	440,717.77	-

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15%的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值扣除本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
基金合同生效日(2019年1月25日)持有的基金份额	10,000,350.04
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	-
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	-
期末持有的基金份额	10,000,350.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.4379%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

**6.4.10.4.2 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未持有本基金。

**6.4.10.5 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 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	19,541,114.02	122,984.18

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明****6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

本报告期末本基金持有基金管理人兴全基金管理有限公司所管理的基金合计124,134,975.67元，占本基金资产净值的比例为16.19%。

**6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

单位：人民币元

项目	本期费用 2019年1月25日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	0.00
当期交易基金产生的赎回费（元）	62,634.03
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	0.00
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	389,673.39
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	74,016.06

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	流通受限类型	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
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
002952	亚世光电	2019年3月20日	2020年3月30日	老股转让锁定	20.76	31.14	23,673	737,177.22	737,177.22	-
002952	亚世光电	2019年6月10日	2020年3月30日	老股转让锁定-转增、送红股	-	31.14	11,836	-	368,573.04	注1
000100	TCL集团	2019年3月25日	2019年9月25日	大宗交易购入流通受限	3.64	3.22	550,000	2,002,000.00	1,771,000.00	-
002384	东山精密	2019年3月18日	2019年9月18日	大宗交易购入流通受限	15.20	13.61	140,000	2,128,000.00	1,905,400.00	-
002773	康弘药业	2019年3月12日	2019年9月12日	大宗交易购入流通受限	31.50	31.23	50,000	2,047,500.00	1,561,500.00	-
002773	康弘药业	2019年6月6日	2019年9月12日	大宗交易购入流通受限-转	-	31.23	15,000	-	468,450.00	注2

				增					
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123027	蓝晓转债	2019年6月13日	2019年7月4日	新债流通受限	100.00	100.00	670	67,000.00	67,000.00	-
113028	环境转债	2019年6月20日	2019年7月8日	新债流通受限	100.00	100.00	2,140	214,000.00	214,000.00	-
113537	文灿转债	2019年6月12日	2019年7月5日	新债流通受限	100.00	100.00	7,210	721,000.00	721,000.00	-

注：1、本基金持有的老股转让股票亚世光电，于2019年6月10日实施2018年年度权益分配方案，向全体股东每10股送红股2.6股，每10股派发现金股利人民币6.80元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增2.4股。本基金新增11,836股。

2、本基金持有的大宗交易购入股票康弘药业，于2019年6月6日实施2018年年度权益分配方案，向全体股东每10股派发现金股利人民币2.80元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每10股转增3股。本基金新增15,000股。

3、上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通

过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部及监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券（不含证券投资基金）市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券（不含证券投资基金），不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日
AAA	18,635,309.10
AAA 以下	34,995,288.54
未评级	-
合计	53,630,597.64

注：本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。



#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理人员设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法規规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金每份基金份额的最短持有期限为3年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满3年（3年指365天乘以3的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额50%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6 月30日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,541,114.02	-	-	-	-	-	19,541,114.02
结算备付金	316,026.57	-	-	-	-	-	316,026.57
存出保证金	58,091.02	-	-	-	-	-	58,091.02
交易性金融资产	20,012,000.00	-	19,992,000.00	20,799,633.20	32,830,964.44	656,401,545.41	750,036,143.05
应收利息	-	-	-	-	-	567,893.69	567,893.69
应收申购款	10,577.15	-	-	-	-	150,168.08	160,745.23

资产总计	39,937,808.76	-19,992,000.00	20,799,633.20	32,830,964.44	657,119,607.18	770,680,013.58
负债						
应付证券清算款					3,304,642.86	3,304,642.86
应付管理人报酬					260,431.83	260,431.83
应付托管费					88,378.59	88,378.59
应付交易费用					20,792.25	20,792.25
应交税费					15,268.54	15,268.54
其他负债					75,967.59	75,967.59
负债总计					3,765,481.66	3,765,481.66
利率敏感度缺口	39,937,808.76	-19,992,000.00	20,799,633.20	32,830,964.44	653,354,125.52	766,914,531.92

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；	
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2019年6月30日）
	利率 +1%	-212,451.05
	利率 -1%	214,115.15

注：1、上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施

监控。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金的权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	32,021,865.71	4.18
交易性金融资产-基金投资	624,379,679.70	81.41
交易性金融资产-债券投资	93,634,597.64	12.21
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	750,036,143.05	97.80

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2019 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准-10%	-80,434,912.66
	业绩比较基准+10%	80,434,912.66

注：1、本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

2、本基金合同于 2019 年 1 月 25 日生效。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	32,021,865.71	4.16
	其中：股票	32,021,865.71	4.16
2	基金投资	624,379,679.70	81.02
3	固定收益投资	93,634,597.64	12.15
	其中：债券	93,634,597.64	12.15
	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	19,857,140.59	2.58
8	其他各项资产	786,729.94	0.10
9	合计	770,680,013.58	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,904,186.50	0.25
C	制造业	21,726,690.69	2.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	347,844.00	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	381,150.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,954,780.72	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	2,602,448.94	0.34
K	房地产业	2,871,414.50	0.37
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	-	-

0	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	193,746.60	0.03
S	综合	-	-
	合计	32,021,865.71	4.18

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000100	TCL 集团	630,000	2,037,400.00	0.27
2	002773	康弘药业	65,000	2,029,950.00	0.26
3	002384	东山精密	140,000	1,905,400.00	0.25
4	002952	亚世光电	35,509	1,105,750.26	0.14
5	002110	三钢闽光	79,600	740,280.00	0.10
6	600507	方大特钢	73,000	713,940.00	0.09
7	000895	双汇发展	22,000	547,580.00	0.07
8	000898	鞍钢股份	134,550	509,944.50	0.07
9	002601	龙鳞佰利	34,100	505,703.00	0.07
10	000157	中联重科	76,300	458,563.00	0.06
11	000069	华侨城A	63,800	443,410.00	0.06
12	002146	荣盛发展	47,000	441,330.00	0.06
13	000581	威孚高科	21,200	393,472.00	0.05
14	600738	兰州民百	52,500	381,150.00	0.05
15	600028	中国石化	67,900	371,413.00	0.05
16	000513	丽珠集团	11,100	368,853.00	0.05
17	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.05
18	600236	桂冠电力	57,400	347,844.00	0.05
19	601003	柳钢股份	60,060	347,747.40	0.05
20	000989	九芝堂	38,000	338,200.00	0.04
21	600376	首开股份	37,200	332,196.00	0.04
22	600808	马钢股份	97,000	330,770.00	0.04
23	600383	金地集团	26,500	316,145.00	0.04
24	600104	上汽集团	12,300	313,650.00	0.04

25	002516	旷达科技	104,563	306,369.59	0.04
26	601636	旗滨集团	78,700	306,143.00	0.04
27	000848	承德露露	36,700	305,711.00	0.04
28	600019	宝钢股份	46,500	302,250.00	0.04
29	601566	九牧王	24,400	300,608.00	0.04
30	002367	康力电梯	40,400	298,152.00	0.04
31	600565	迪马股份	76,300	284,599.00	0.04
32	002233	塔牌集团	24,300	283,824.00	0.04
33	000001	平安银行	20,400	281,112.00	0.04
34	000036	华联控股	54,990	280,998.90	0.04
35	002352	顺丰控股	8,200	278,472.00	0.04
36	603328	依顿电子	27,100	278,317.00	0.04
37	600741	华域汽车	12,700	274,320.00	0.04
38	002016	世荣兆业	32,600	267,320.00	0.03
39	000538	云南白药	3,200	266,944.00	0.03
40	000402	金融街	33,900	265,776.00	0.03
41	002536	飞龙股份	44,400	262,404.00	0.03
42	000338	潍柴动力	21,200	260,548.00	0.03
43	000789	万年青	25,900	259,518.00	0.03
44	002142	宁波银行	10,700	259,368.00	0.03
45	000166	申万宏源	50,900	255,009.00	0.03
46	001965	招商公路	30,300	252,399.00	0.03
47	000423	东阿阿胶	6,300	250,866.00	0.03
48	600395	盘江股份	42,300	249,993.00	0.03
49	000709	河钢股份	82,200	245,778.00	0.03
50	000718	苏宁环球	69,260	239,639.60	0.03
51	002415	海康威视	8,600	237,188.00	0.03
52	600398	海澜之家	26,000	235,820.00	0.03
53	000625	长安汽车	35,500	235,365.00	0.03
54	603877	太平鸟	15,100	234,352.00	0.03
55	000488	晨鸣纸业	41,100	220,296.00	0.03
56	603156	养元饮品	5,900	218,772.00	0.03
57	600688	上海石化	41,800	215,688.00	0.03
58	601328	交通银行	35,200	215,424.00	0.03
59	600309	万华化学	4,900	209,671.00	0.03
60	601006	大秦铁路	25,300	204,677.00	0.03
61	600971	恒源煤电	34,865	203,960.25	0.03
62	002068	黑猫股份	40,700	203,093.00	0.03
63	601088	中国神华	9,900	201,762.00	0.03

64	300121	阳谷华泰	24,720	197,760.00	0.03
65	600660	福耀玻璃	8,700	197,751.00	0.03
66	600114	东睦股份	31,300	196,877.00	0.03
67	600742	一汽富维	18,378	196,093.26	0.03
68	000429	粤高速A	25,700	194,035.00	0.03
69	600897	厦门空港	7,900	190,469.00	0.02
70	600409	三友化工	33,500	189,610.00	0.02
71	002242	九阳股份	9,100	189,371.00	0.02
72	002327	富安娜	24,600	183,762.00	0.02
73	600188	兖州煤业	16,900	183,703.00	0.02
74	601169	北京银行	30,900	182,619.00	0.02
75	601515	东风股份	23,380	180,727.40	0.02
76	601288	农业银行	48,700	175,320.00	0.02
77	601818	光大银行	45,800	174,498.00	0.02
78	000726	鲁泰A	18,200	173,992.00	0.02
79	601998	中信银行	29,000	173,130.00	0.02
80	601939	建设银行	23,200	172,608.00	0.02
81	601398	工商银行	29,300	172,577.00	0.02
82	603167	渤海轮渡	17,400	171,738.00	0.02
83	002042	华孚时尚	23,600	171,336.00	0.02
84	002083	孚日股份	30,300	171,195.00	0.02
85	601098	中南传媒	13,500	170,640.00	0.02
86	600350	山东高速	35,300	169,440.00	0.02
87	601009	南京银行	20,500	169,330.00	0.02
88	600016	民生银行	26,600	168,910.00	0.02
89	601988	中国银行	45,100	168,674.00	0.02
90	600261	阳光照明	45,800	168,086.00	0.02
91	600548	深高速	17,900	168,081.00	0.02
92	601225	陕西煤业	18,100	167,244.00	0.02
93	300195	长荣股份	19,600	165,424.00	0.02
94	001872	招商港口	10,012	163,295.72	0.02
95	600348	阳泉煤业	28,000	162,680.00	0.02
96	600377	宁沪高速	15,100	162,174.00	0.02
97	600761	安徽合力	16,300	156,480.00	0.02
98	002004	华邦健康	31,300	152,118.00	0.02
99	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.01
100	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.01
101	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
102	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00



103	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
104	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
105	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000100	TCL 集团	2,255,890.00	0.29
2	002384	东山精密	2,128,000.00	0.28
3	002773	康弘药业	2,047,500.00	0.27
4	002952	亚世光电	737,177.22	0.10
5	002110	三钢闽光	718,137.00	0.09
6	600507	方大特钢	656,057.00	0.09
7	000625	长安汽车	643,110.00	0.08
8	000338	潍柴动力	620,071.00	0.08
9	600383	金地集团	538,272.00	0.07
10	000898	鞍钢股份	528,741.00	0.07
11	600019	宝钢股份	527,845.00	0.07
12	000895	双汇发展	524,055.00	0.07
13	601088	中国神华	496,955.00	0.06
14	002601	龙蟠佰利	488,733.00	0.06
15	000876	新 希望	472,380.00	0.06
16	600325	华发股份	468,570.00	0.06
17	002146	荣盛发展	452,128.00	0.06
18	000157	中联重科	449,827.00	0.06
19	600738	兰州民百	421,226.00	0.05
20	000069	华侨城 A	412,761.02	0.05

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	000876	新 希望	1,144,749.00	0.15

2	000338	潍柴动力	586,178.00	0.08
3	600325	华发股份	537,801.00	0.07
4	000333	美的集团	481,032.00	0.06
5	000858	五粮液	424,468.00	0.06
6	600989	宝丰能源	369,724.08	0.05
7	002736	国信证券	368,977.00	0.05
8	000776	广发证券	364,101.00	0.05
9	000625	长安汽车	346,692.00	0.05
10	000783	长江证券	333,158.00	0.04
11	601088	中国神华	286,846.00	0.04
12	600900	长江电力	271,128.00	0.04
13	600383	金地集团	265,630.00	0.03
14	000631	顺发恒业	240,428.00	0.03
15	000157	中联重科	235,562.00	0.03
16	002142	宁波银行	223,691.00	0.03
17	000656	金科股份	219,996.00	0.03
18	601166	兴业银行	217,063.00	0.03
19	601158	重庆水务	215,893.00	0.03
20	600020	中原高速	211,493.00	0.03

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	43,753,512.79
卖出股票收入（成交）总额	15,522,780.61

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,004,000.00	5.22
	其中：政策性金融债	40,004,000.00	5.22
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）	53,630,597.64	6.99

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	93,634,597.64	12.21

## 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130208	13 国开 08	200,000	20,012,000.00	2.61
2	190201	19 国开 01	200,000	19,992,000.00	2.61
3	132018	G 三峡 EB1	102,240	10,224,000.00	1.33
4	128048	张行转债	74,660	7,833,327.20	1.02
5	110053	苏银转债	45,640	4,867,506.00	0.63

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有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。

## 7.8 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贵金属投资明细

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，且作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值，在风控策略上将相对收益风险、子基金风格漂移风险及整体流动性风险进行重点控制。本基金主要投资于公开募集证券投资基金，整体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

### 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	002864	广发安泽短债A	契约型开放式	47,569,044.45	50,599,192.58	6.60	否
2	000147	易方达高等级信用债债券A	契约型开放式	25,808,092.25	30,479,356.95	3.97	否
3	162712	广发聚利债券A(LOF)	上市开放式基金(LOF)	20,934,403.35	30,126,699.86	3.93	否
4	163407	兴全沪深300指数(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	11,830,635.12	23,048,443.34	3.01	是
5	340009	兴全磐稳增利债券	契约型开放式	16,625,402.17	21,987,094.37	2.87	是
6	001819	兴全稳益定期开放债券	契约型开放式	19,470,204.31	21,267,304.17	2.77	是
7	164808	工银四季收益债券	上市开放式基金(LOF)	18,921,799.29	20,236,864.34	2.64	否
8	000286	银华信用季季红债券	契约型开放式	19,091,560.15	20,217,962.20	2.64	否
9	166005	中欧价值发现混合	契约型开放式	13,042,128.94	20,079,661.72	2.62	否
10	001256	泓德优选成长混合	契约型开放式	18,526,174.88	19,823,007.12	2.58	否

11	340001	兴全可转债混合	契约型开放式	18,146,804.10	19,638,471.40	2.56	是
12	510500	500ETF	交易型开放式	3,302,776.00	17,610,401.63	2.30	否
13	163402	兴全趋势投资混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	22,143,489.81	16,700,620.01	2.18	是
14	260116	景顺长城核心竞争力混合	契约型开放式	5,237,671.23	16,304,870.54	2.13	否
15	519736	交银新成长混合	契约型开放式	7,091,653.03	15,963,310.97	2.08	否
16	163412	兴全轻资产混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	4,656,570.63	15,734,552.16	2.05	是
17	160916	大成优选混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	5,475,568.66	15,632,748.52	2.04	否
18	519069	汇添富价值精选混合	契约型开放式	6,302,554.17	15,453,862.82	2.02	否
19	511990	华宝添益	契约型开放式	150,690.00	15,069,904.14	1.97	否
20	161017	富国中证500指数增强（LOF）	契约型开放式	8,700,803.21	15,026,287.14	1.96	否
21	000527	南方新优享灵活配置混合	契约型开放式	6,137,393.76	15,012,065.14	1.96	否
22	020001	国泰金鹰增长灵活配置混合	契约型开放式	16,471,109.98	14,919,531.42	1.95	否
23	110011	易方达中小盘混合	契约型开放式	2,890,486.33	14,360,514.18	1.87	否
24	162607	景顺长城资源垄断混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	29,245,524.30	14,359,552.43	1.87	否
25	166001	中欧新趋势混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	12,183,692.20	14,309,746.49	1.87	否
26	511880	银华日利	契约型开	139,986.00	14,196,400.22	1.85	否

			放式				
27	000457	上投摩根 核心成长 股票	契约型开 放式	8,895,953.31	13,762,039.77	1.79	否
28	160505	博时主题 行业混合	契约型上 市开放式	7,905,708.27	12,498,924.77	1.63	否
29	510900	H股ETF	交易型开 放式 (ETF)	9,161,390.00	11,011,990.78	1.44	否
30	233005	大摩强收 益债券	契约型开 放式	5,546,372.31	10,104,381.07	1.32	否
31	000024	大摩双利 增强债券 A	契约型开 放式	8,531,569.97	9,981,936.86	1.30	否
32	260112	景顺长城 能源基建 混合	契约型开 放式	6,343,019.54	9,019,773.79	1.18	否
33	169105	东证睿华	契约型开 放式	6,010,203.00	7,374,519.08	0.96	否
34	168103	九泰锐益	契约型开 放式	8,855,308.00	6,942,561.47	0.91	否
35	161834	银华鑫锐	契约型开 放式	7,401,323.00	5,817,439.88	0.76	否
36	240022	华宝资源 优选混合	契约型开 放式	3,986,443.38	5,489,332.53	0.72	否
37	340007	兴全社会 责任混合	契约型开 放式	1,653,986.10	5,261,329.78	0.69	是
38	510050	50ETF	交易型开 放式	1,775,704.00	5,241,878.21	0.68	否
39	510300	华泰柏瑞 沪深 300ETF	交易型开 放式	1,086,100.00	4,191,259.90	0.55	否
40	168101	九泰锐智	契约型开 放式	4,011,400.00	3,782,750.20	0.49	否
41	159939	信息技术	交易型开 放式	2,745,400.00	2,591,657.60	0.34	否
42	168105	九泰泰富	契约型开 放式	1,755,146.00	1,337,421.25	0.17	否
43	169102	东证睿阳	契约型定 期开放式	1,297,018.00	1,258,107.46	0.16	否
44	163402	兴全趋势	上市契约 型开放式 (LOF)	664,653.00	497,160.44	0.06	是

45	510800	上证50	交易型开放式	54,500.00	56,789.00	0.01	否
----	--------	------	--------	-----------	-----------	------	---

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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。

#### 7.13.2 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。

#### 7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	58,091.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	567,893.69
5	应收申购款	160,745.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	786,729.94

#### 7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128048	张行转债	7,833,327.20	1.02
2	113505	杭电转债	2,551,710.00	0.33
3	110047	山鹰转债	1,912,622.10	0.25
4	113509	新泉转债	1,181,786.40	0.15
5	113014	林洋转债	975,284.90	0.13
6	127006	敖东转债	909,739.70	0.12
7	113525	台华转债	861,827.70	0.11
8	113017	吉视转债	791,920.80	0.10
9	128013	洪涛转债	764,483.20	0.10
10	113519	长久转债	671,656.30	0.09
11	128032	双环转债	669,748.50	0.09

12	128010	顺昌转债	479,526.90	0.06
13	113518	顾家转债	203,816.80	0.03

### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002773	康弘药业	2,029,950.00	0.26	大宗交易购入流通受限
2	002384	东山精密	1,905,400.00	0.25	大宗交易购入流通受限
3	000100	TCL 集团	1,771,000.00	0.23	大宗交易购入流通受限
4	002952	亚世光电	1,105,750.26	0.14	新股流通受限

### 7.13.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
66,741	10,420.88	20,964,216.83	3.01%	674,535,619.74	96.99%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	14,091,339.12	2.0261%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------



本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

注：本基金的基金经理也是本公司投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年1月25日）基金份额总额	628,976,962.65
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	66,522,873.92
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	695,499,836.57

注：买入/申购总份额含红利再投资份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）报告期内基金管理人重大人事变动。

2019年4月12日公告，自2019年4月12日起，詹鸿飞先生担任公司副总经理暨首席信息官，严长胜先生担任公司副总经理。

（2）报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 本报告持有的基金发生的重大影响事件

无。

#### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

#### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

#### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	3	57,335,949.44	100.00%	49,479.53	100.00%	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

##### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	125,897,342.28	100.00%	1,039,000,000.00	100.00%	-	-

#### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加兴证期货有限公司为兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）销售机	中国证券报、基金管理人网站	2019年1月7日

	构的公告		
2	关于增加浦发银行为兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年1月14日
3	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年1月26日
4	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购业务的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年2月20日
5	关于兴全安泰平衡养老目标三年持有混合型基金中基金（FOF）参加部分销售机构申购、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年2月25日
6	关于调整旗下基金在兴业证券费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年2月27日
7	关于增加兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）销售机构的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年3月1日
8	关于兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）在光大银行开放日常申购业务及参加申购费率、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年3月29日
9	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年3月29日
10	关于增聘副总经理的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年4月12日
11	关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年6月22日
12	关于调整网上直销基金转换、赎回申购优惠费率的公告	中国证券报、基金管理人网站	2019年6月27日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复文件
- 2、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同
- 3、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会规定的其它文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 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。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴全基金管理有限公司

2019年8月24日