

# 兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混 合型基金中基金（FOF） 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 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。本中期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 2023 年 08 月 30 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 2023 年 01 月 01 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	14
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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、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>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50

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	50
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	50
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	本报告期投资基金情况	50
7.13	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>59</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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情况	59
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>60</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>60</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4	基金投资策略的改变	60
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	61
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.9	其他重大事件	66
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>67</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	67
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	67
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>68</b>
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	68
12.3	查阅方式	68

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF	
基金主代码	012509	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 9 月 17 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
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	2,688,972,172.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y
下属分级基金的交易代码	012509	017387
报告期末下属分级基金的份额总额	2,666,783,417.17 份	22,188,755.81 份

注：本基金每份基金份额最短持有期为 1 年。

### 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，本基金定位为稳健型的目标风险策略基金，根据特定的风险偏好设定权益类和固定收益类资产的比例，来获取养老资金的长期稳健增值。具体投资策略包括：资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、风险控制策略、公募 REITs 投资策略等。（详见本基金招募说明书）
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。
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。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 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		兴证全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露	姓名	杨卫东	张姗

露负责人	联系电话	021-20398888	0755-83077987
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398988	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 28-29 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		杨华辉	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	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	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y
本期已实现收益	-169,992.65	31,728.05
本期利润	103,392,680.30	419,837.78
加权平均基金份额本期利润	0.0289	0.0235
本期加权平均净值利润率	2.87%	2.33%
本期基金份额净值增长率	2.57%	2.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	42,924,245.41	403,879.14
期末可供分配基金份额利润	0.0161	0.0182
期末基金资产净值	2,716,447,596.78	22,649,100.04
期末基金份额净值	1.0186	1.0207
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.86%	2.82%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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 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

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A

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	1.14%	0.19%	0.73%	0.23%	0.41%	-0.04%
过去三个月	0.72%	0.17%	-0.55%	0.19%	1.27%	-0.02%
过去六个月	2.57%	0.18%	0.21%	0.20%	2.36%	-0.02%
过去一年	1.55%	0.20%	-2.55%	0.24%	4.10%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.86%	0.21%	-3.50%	0.28%	5.36%	-0.07%

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	--------	----------	----------	--------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	1.17%	0.19%	0.73%	0.23%	0.44%	-0.04%
过去三个月	0.80%	0.17%	-0.55%	0.19%	1.35%	-0.02%
过去六个月	2.73%	0.18%	0.21%	0.20%	2.52%	-0.02%
自基金合同生效 起至今	2.82%	0.18%	0.74%	0.20%	2.08%	-0.02%

注：1、本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：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。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，且原则上会以 25% 的基金资产投资于权益类资产，因此本基金业绩比较基准中的 20% 选择了中证偏股型基金指数收益率，5% 选择了恒生指数收益率（使用估值汇率折算）。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，适合作为本基金债券投资业绩的比较基准。

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：

$$\text{Return } t = 20\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率 } t / \text{中证偏股型基金指数收益率 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数收益率 } t / \text{恒生指数收益率 } t-1 - 1) + 75\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率 } t / \text{中债综合（全价）指数收益率 } t-1 - 1)$$

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

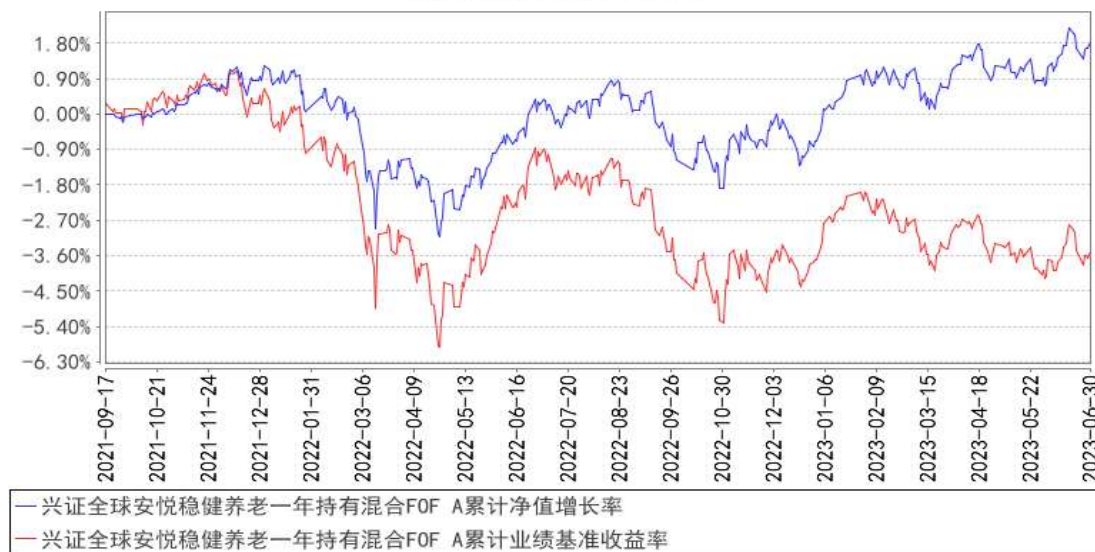
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

2、本基金于 2022 年 11 月 17 日公告增设 Y 类基金份额，并于 2022 年 11 月 23 日开始办理申购等相关业务。

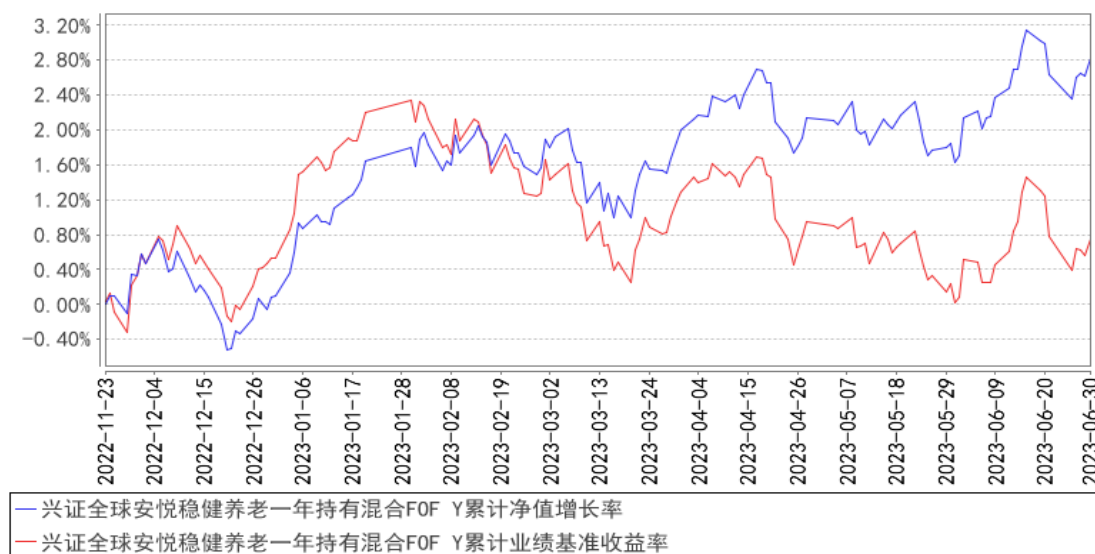


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合FOF A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



兴证全球安悦稳健养老一年持有混合FOF Y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 2023 年 06 月 30 日。

2、按照《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 09 月 17 日起共计六个月。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、本基金于 2022 年 11 月 17 日公告增设 Y 类基金份额，并于 2022 年 11 月 23 日开始办理申购等相关业务。

### 3.3 其他指标

注：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

兴证全球基金管理有限公司（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”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至2023年6月30日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共58只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF等类型。

#### 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 投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF、兴全优选进取三个月持有混合 FOF、兴全	2021 年 9 月 17 日	-	16 年	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，兴证全球基金管理有限公司兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。

	安泰积极养老五年持有混合发起式 FOF、兴证全球优选平衡三个月持有混合 FOF、兴证全球安悦稳健养老目标一年持有混合 FOF、兴证全球积极配置三年封闭运作混合 FOF-LOF、兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF、兴证全球优选积极三个月持有混合 FOF 基金经理				
--	--	--	--	--	--

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、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《兴证全球安悦稳健养老目标一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，不存在本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

2023 年上半年 A 股市场呈现结构性行情，尽管上证综指上涨 3.65%，但市场内部分化较为明显。从主流宽基指数看，中证 1000、上证红利、科创 50 指数表现较好，分别上涨 5.10%、5.03% 和 4.71%，而创业板 50、创业板指、上证 50 指数下跌幅度较大，分别下跌 9.33%、5.61% 和 5.43%。从申万一级行业表现来看，受益于 AI 行情推动的 TMT 板块涨幅较大，尤其是通信、传媒行业涨幅均超过 40%，计算机行业涨幅接近 30%，而与宏观经济关联度高的行业表现较为落后，其中商贸零售、房地产和美容护理跌幅最大，分别下跌 23.44%、14.29%、13.61%。从风格指数上来看，中价股表现优于高价股、低价股指数，小盘指数表现优于中、大盘指数，微利股指数优于亏损股、绩优股指数，另外高、低市盈率指数表现优于中市盈率指数，中、低市净率指数优于高市净率指数。上半年债券市场方面表现相对突出，其中，中债总财富指数上涨 2.55%，中债银行间国债财富指数上涨 2.66%，中债企业债总财富指数上涨 3.96%，中证转债指数上涨 3.37%。从基金指数上看，中证偏股基金指数下跌 3.60%，中长期纯债基金指数上涨 2.11%，黄金 ETF 上涨 9.11%，以人民币计价的标普 500ETF 净值上涨 19.81%，纳斯达克 ETF 净值上涨 44.71%。

上半年，组合的主要操作方向主要有：1、资产配置层面：鉴于股票市场处于相对偏低估的状态，始终保持权益配置比例略超配，此外，QDII 基金、黄金 ETF 等资产的配置比例维持稳定，通过“多资产”方式优化组合的风险收益特征；2、风格配置层面：自 2021 年 2 月份以来，价值股表现持续优于成长股，尤其是高质量方向的成长股已经由极度高估状态调整到一个相对合理水平，

所以组合层面逐步地降低价值型基金比例，提升成长型基金（尤其是质量成长型）基金的配置比例；3、“多策略”层面：继续依据既定的策略参与股票定增、折价基金等投资机会，积极挖掘市场上相对确定的投资机会；4、固定收益资产层面：随着债券收益率的下行和信用利差的继续收窄，组合降低了以信用挖掘和中短久期债券为主要投资策略的债券基金配置比例，采用公司内部的货币市场基金进行替换。

我们的选品逻辑一般不与短期市场表现挂钩，坚持从长期业绩、投资风格、盈利模式三个角度选择优秀的基金经理管理的基金品种，长期持有；在品种的持仓比例上，我们重点考虑的是组合搭配和投资性价比。

目前权益部分依然保持略超配价值风格，但偏离幅度继续下降，我们保持一贯的“略偏左侧”和“适度均衡”的配置策略，通过积极挖掘市场上相对收益和绝对收益的投资机会不断增厚组合收益，通过“多资产、多策略”的方式来平滑组合波动，努力将该基金呈现为“相对稳定的‘贝塔’和相对确定的‘阿尔法’特征”。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A 的基金份额净值为 1.0186 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%；截至本报告期末兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y 的基金份额净值为 1.0207 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.73%，同期业绩比较基准收益率为 0.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着政策焦点从疫情防控转向经济增长，年初市场一度异常乐观，我们在基金调研的过程中也深刻感受到了投资者的乐观、亢奋情绪，虽然隐隐感觉到可能存在的预期差，但是我也一样找不到需要谨慎的理由；但从二季度开始，随着经济数据的低于预期、汇率波动加大等因素影响，调研过程中又深刻地感受到投资者情绪的极度低落，整体性的情绪变动主导了上半年股票市场估值的较大波动。

我们认为当前 A 股市场依然具有较高的配置价值，而债券市场的整体收益率预期相对较低，所以我们将继续维持适度超配权益的方式，主要有以下几点原因：

从估值水平来看，目前股票市场的估值水平相对偏低，沪深 300 指数的 TTM 市盈率 12 倍、中证 500 指数 23 倍、创业板指数 33 倍，均处于历史均值以下水平；从股债性价比模型来看，目前 A 股市场相对于债券市场的投资价值更优。

从政策角度来看，7 月 19 日《中共中央国务院关于促进民营经济发展壮大的意见》发布，我们认为可能是一个相对重要的“政策底”。

此外，从资金面的角度来看，过去三年受疫情和房地产市场影响，国内资金整体的风险偏好持续降低，目前大量的资金堆积在诸如银行存款、短债基金、定额终身寿险等产品上，一旦投资者情绪有所修复，可能会导致大量的资金需要重新配置。

基于以上的判断，我们认为当前阶段需要对权益类资产更加积极一些，但依然需要保持基金持续稳定的风险收益特征，控制与业绩比较基准的偏离幅度，力争在获取一定的超额收益的同时能够有效地降低波动率和回撤。

本基金是一只稳健型的养老目标基金，权益类资产的配置中枢为 25%，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，兼顾长期收益率和改善持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值和养老储备。

#### 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、合规管理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；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

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》、《兴证全球安悦稳健养老目标一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

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、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：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	58,020,649.98	79,785,993.14
结算备付金		-	38,712.05
存出保证金		62,747.52	23,291.66
交易性金融资产	6.4.7.2	2,677,331,316.53	4,595,001,584.01
其中：股票投资		18,058,943.09	135,950,055.15
基金投资		2,489,413,540.09	4,173,447,621.73
债券投资		169,858,833.35	285,603,907.13
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-12,021.92	-4,565.50
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		44,018,027.58	23,188,144.89
应收股利		-	-
应收申购款		272,858.90	2,234,132.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	110.41	-
资产总计		2,779,693,689.00	4,700,267,292.35
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		39,008,570.27	30,203,093.59
应付管理人报酬		1,152,637.36	2,059,458.39
应付托管费		323,909.77	560,969.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		107.41	276.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	111,767.37	215,344.40
负债合计		40,596,992.18	33,039,142.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,688,972,172.98	4,699,694,878.34
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	50,124,523.84	-32,466,728.44
净资产合计		2,739,096,696.82	4,667,228,149.90
负债和净资产总计		2,779,693,689.00	4,700,267,292.35

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A 基金份额净值 1.0186 元，基金份额总额 2,666,783,417.17 份；兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y 基金份额净值 1.0207 元，基金份额总额 22,188,755.81 份。兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF 份额总额合计为 2,688,972,172.98 份。



## 6.2 利润表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		115,615,225.84	-38,358,287.18
1. 利息收入		154,842.13	179,550.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	144,265.67	150,249.47
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		10,576.46	29,301.35
证券出借利息 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		11,509,490.62	57,399,257.75
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,475,817.71	-6,042,373.58
基金投资收益	6.4.7.15	-6,449,651.79	-4,205,570.30
债券投资收益	6.4.7.16	2,120,704.08	4,178,853.36
资产支持证券 投资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收 益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	27,314,256.04	63,468,348.27
以摊余成本计 量的金融资产终止确 认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.21	103,950,782.68	-95,939,628.49
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.22	110.41	2,532.74
<b>减：二、营业总支出</b>		11,802,707.76	20,496,742.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,157,087.59	16,111,148.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,523,634.93	4,282,062.95

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		85.99	59.44
8. 其他费用	6.4.7.25	121,899.25	103,472.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		103,812,518.08	-58,855,029.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		103,812,518.08	-58,855,029.89
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		103,812,518.08	-58,855,029.89

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,699,694,878.34	-	-32,466,728.44	4,667,228,149.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,699,694,878.34	-	-32,466,728.44	4,667,228,149.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,010,722,705.36	-	82,591,252.28	1,928,131,453.08
（一）、综合收益总额	-	-	103,812,518.08	103,812,518.08
（二）、本期基金份额交易产生的	-	-	-21,221,265.80	-

基金净值变动数 （净值减少以 “-”号填列）	2,010,722,705. 36			2,031,943,971.1 6
其中：1. 基金申 购款	15,967,848.97	-	131,775.84	16,099,624.81
2. 基金赎 回款	- 2,026,690,554. 33	-	-21,353,041.64	- 2,048,043,595.9 7
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产（基金净值）	2,688,972,172. 98	-	50,124,523.84	2,739,096,696.8 2
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产（基金净值）	6,348,186,797. 73	-	78,600,313.23	6,426,787,110.9 6
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产（基金净值）	6,348,186,797. 73	-	78,600,313.23	6,426,787,110.9 6
三、本期增减变 动额（减少以“-” 号填列）	8,083,680.88	-	-58,864,624.35	-50,780,943.47
（一）、综合收益 总额	-	-	-58,855,029.89	-58,855,029.89
（二）、本期基金 份额交易产生的 基金净值变动数	8,083,680.88	-	-9,594.46	8,074,086.42

（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	8,083,680.88	-	-9,594.46	8,074,086.42
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	6,356,270,478.61	-	19,735,688.88	6,376,006,167.49

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：

杨华辉

基金管理人负责人

庄园芳

主管会计工作负责人

詹鸿飞

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”）系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴证全球安悦稳健养老目标一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”）证监许可[2021]1694号文准予公开募集注册。本基金为契约型、开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 6,344,209,810.91 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具了验资报告。基金合同于 2021 年 9 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

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、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公

募 REITs”）、国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×75%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》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〈年度和中期报告〉》以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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金于2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金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

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》、《关于继续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的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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《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，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (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。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日

的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(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) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，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 2013 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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。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，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	58,020,649.98
等于：本金	58,013,447.87
加：应计利息	7,202.11
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	58,020,649.98

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,659,974.99	-	18,058,943.09	2,398,968.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	61,835.56	17,101,882.66	487,322.18
	银行间市场	150,515,040.00	2,381,950.69	-140,040.00
	合计	167,067,764.92	2,443,786.25	169,858,833.35
资产支持证券	-	-	-	-
基金	2,529,307,396.34	-	2,489,413,540.09	-
其他	-	-	-	39,893,856.25
合计	2,712,035,136.25	2,443,786.25	2,677,331,316.53	-
				37,147,605.97



### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-12,021.92	-
银行间市场	-	-
合计	-12,021.92	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末本基金无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	110.41
待摊费用	-
合计	110.41

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,507.22
其中：交易所市场	21,832.22
银行间市场	675.00
应付利息	-
预提费用	89,260.15
合计	111,767.37

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,690,160,785.04	4,690,160,785.04
本期申购	3,313,186.46	3,313,186.46
本期赎回（以“-”号填列）	-2,026,690,554.33	-2,026,690,554.33
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,666,783,417.17	2,666,783,417.17

## 兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,534,093.30	9,534,093.30
本期申购	12,654,662.51	12,654,662.51
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,188,755.81	22,188,755.81

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	75,202,571.31	-107,607,821.66	-32,405,250.35
本期利润	-169,992.65	103,562,672.95	103,392,680.30
本期基金份额交易产生的变动数	-32,108,333.25	10,785,082.91	-21,323,250.34
其中：基金申购款	52,757.24	-22,965.94	29,791.30
基金赎回款	-32,161,090.49	10,808,048.85	-21,353,041.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,924,245.41	6,739,934.20	49,664,179.61

## 兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	157,285.75	-218,763.84	-61,478.09
本期利润	31,728.05	388,109.73	419,837.78
本期基金份额交易产生的变动数	214,865.34	-112,880.80	101,984.54
其中：基金申购款	214,865.34	-112,880.80	101,984.54
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	403,879.14	56,465.09	460,344.23

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
----	---------------------------------------	--

活期存款利息收入	142,819.36
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	995.56
其他	450.75
合计	144,265.67

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,475,817.71
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-11,475,817.71

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	142,429,568.49
减：卖出股票成本总额	153,643,797.96
减：交易费用	261,588.24
买卖股票差价收入	-11,475,817.71

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	2,506,279,359.10
减：卖出/赎回基金成本总额	2,512,062,041.52
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	666,969.37
基金投资收益	-6,449,651.79

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,213,798.55
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-93,094.47
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	2,120,704.08

## 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	180,960,758.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	177,674,560.55
减：应计利息总额	3,377,778.42
减：交易费用	1,514.39
买卖债券差价收入	-93,094.47

## 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

**6.4.7.18 贵金属投资收益****6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.19 衍生工具收益****6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.20 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	39,267.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	27,274,988.64
合计	27,314,256.04

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	103,950,782.68
股票投资	21,848,965.23
债券投资	958,471.35
资产支持证券投资	-
基金投资	81,143,346.10
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	103,950,782.68

#### 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	110.41
合计	110.41

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	166.06
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	8,534,651.94
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	2,006,175.24

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。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	23,639.10
账户维护费	9,000.00
合计	121,899.25

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“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（“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 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	142,429,568.49	100.00	53,810,225.98	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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	8,964,052.11	100.00	9,751,373.93	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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）
兴业证券	40,000,000.00	100.00	119,500,000.00	100.00



## 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期基金 成交总额的比 例（%）
兴业证券	200,446,785.00	100.00	90,841,477.01	100.00

## 6.4.10.1.5 权证交易

注：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。

## 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	107,944.83	100.00	21,832.22	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	37,696.15	100.00	29,381.64	100.00

注：1、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。

2、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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,157,087.59	16,111,148.11
其中：支付销售机构的客户维护 费	5,246,634.05	9,037,007.93

注：兴证全球安悦稳健养老一年持有混合(FOF)-A 支付基金管理人兴证全球基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.60%的

年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）×0.60%/当年天数

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合(FOF)-Y 支付基金管理人兴证全球基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）×0.30%/当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,523,634.93	4,282,062.95

注：兴证全球安悦稳健养老一年持有混合(FOF)-A 支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）的 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）×0.15%/当年天数

兴证全球安悦稳健养老一年持有混合(FOF)-Y 支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）的 0.075%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）×0.075%/当年天数

#### 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

注：本基金在本报告期内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。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内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。

##### 6.4.10.5.2 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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
招商银行	58,020,649.98	142,819.36	80,447,469.66	146,498.12

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末及上年度末均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计 677,682,910.25 元，占基金资产净值的比例为 24.74%。

##### 6.4.10.8.2 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

项目	本期费用 2023年1月1日至2023年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	34,985.66	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	166.06	2,552.06
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,554,347.93	2,193,742.16
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	369,162.24	541,904.55

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。

根据本基金合同的约定，本基金管理人运用本基金基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除

外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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	受限期	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
000701	厦门信达	2023 年 6 月 28 日	6 个月	非公开发行流通受限	5.19	6.09	192,678	999,998.82	1,173,409.02	-
002487	大金重工	2022 年 12 月 30 日	6 个月	非公开发行流通受限	37.35	30.52	53,547	1,999,980.45	1,634,254.44	-
002765	蓝黛科技	2023 年 2 月 17 日	6 个月	非公开发行流通受限	7.91	8.04	252,845	2,000,003.95	2,032,873.80	-
002865	钧达股份	2023 年 6 月 16 日	6 个月	非公开发行流通受限	100.00	138.51	20,000	2,000,000.00	2,770,200.00	-
300020	银江技术	2023 年 5 月 16 日	6 个月	非公开发行流通受限	7.20	8.57	184,722	1,329,998.40	1,583,067.54	-
300442	润泽科技	2023 年 2 月 14 日	6 个月	非公开发行流通受限	35.22	29.60	56,786	2,000,002.92	1,680,865.60	-
300442	润泽科技	2023 年 5 月 24 日	3 个月	非公开发行流通受限-转增	-	29.60	45,429	-	1,344,698.40	注 1
601500	通用股份	2023 年 3 月 24 日	6 个月	非公开发行流通受限	3.48	4.00	287,356	999,998.88	1,149,424.00	-
601778	晶科科技	2023 年 2 月 28 日	6 个月	非公开发行流通受限	4.43	4.85	451,467	1,999,998.81	2,189,614.95	-
603912	佳力	2023 年	6 个	非公开	10.95	9.49	91,324	999,997.80	866,664.76	-

	图	3月30日	月	发行流通受限						
603912	佳力图	2023年6月9日	4个月	非公开发行流通受限-转增	-	9.49	36,530	-	346,669.70	注2
603936	博敏电子	2023年4月10日	6个月	非公开发行流通受限	11.81	11.43	112,616	1,329,994.96	1,287,200.88	-

注：1. 本基金持有的非公开发行股票润泽科技，于2023年5月24日实施2022年年度权益分配方案，向全体股东按每10股转增8股。本基金新增45,429股。

2. 本基金持有的非公开发行股票佳力图，于2023年6月9日实施2022年年度权益分配方案，每股派发现金红利0.1元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增0.4股。本基金新增36,530股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限证券。

#### 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

注：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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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、风险管理部和合规管理部以及审计部、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

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	14,852,887.08	17,099,357.09
AAA 以下	2,248,995.58	5,134,330.85
未评级	-	-
合计	17,101,882.66	22,233,687.94

注：此处的信用证券不包括国债、央票、政策性金融债券等非信用债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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，另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。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在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。

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部门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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为具有一定持有期的开放式基金，符合条件的其他投资者可在合同规定的开放日进行基金申购与赎回业务，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。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

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。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，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 202 3 年 6 月	1 个月以内	1	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
		- 3 个 月					

30 日						
资产						
银行存款	58,020,649.98	-	-	-	-	58,020,649.98
存出保证金	62,747.52	-	-	-	-	62,747.52
交易性金融资产	91,618,101.37	61,138,849.32	16,616,013.92	485,868.74	2,507,472,483.18	2,677,331,316.53
买入返售金融资产	-12,021.92	-	-	-	-	-12,021.92
应收申购款	11,373.89	-	-	-	261,485.01	272,858.90
应收清算款	-	-	-	-	44,018,027.58	44,018,027.58
其他资产	-	-	-	-	110.41	110.41
资产总	149,700,850.84	61,138,849.32	16,616,013.92	485,868.74	2,551,752,106.18	2,779,693,689.00



计							
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	39,008,570.27	39,008,570.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,152,637.36	1,152,637.36
应付托管费	-	-	-	-	-	323,909.77	323,909.77
应交税费	-	-	-	-	-	107.41	107.41
其他负债	-	-	-	-	-	111,767.37	111,767.37
负债总计	-	-	-	-	-	40,596,992.18	40,596,992.18
利率敏感度缺口	149,700,850.84	61,138,849.32	16,616,013.92	485,868.74	2,511,155,114.00	2,739,096,696.82	
上年度末 2022 年	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

12月31日						
资产						
银行存款	79,785,993.14	-	-	-	-	79,785,993.14
结算备付金	38,712.05	-	-	-	-	38,712.05
存出保证金	23,291.66	-	-	-	-	23,291.66
交易性金融资产	-	263,370,219.19	18,966,014.30	3,267,673.64	4,309,397,676.88	4,595,001,584.01
买入返售金融资产	-4,565.50	-	-	-	-	-4,565.50
应收申购款	808.07	-	-	-	2,233,324.03	2,234,132.10
应收清算款	-	-	-	-	23,188,144.89	23,188,144.89

资产总计	79,844,239.42	263,370,219.19	18,966,014.30	3,267,673.64	4,334,819,145.80	4,700,267,292.35
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	30,203,093.59	30,203,093.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,059,458.39	2,059,458.39
应付托管费	-	-	-	-	560,969.45	560,969.45
应交税费	-	-	-	-	276.62	276.62
其他负债	-	-	-	-	215,344.40	215,344.40
负债总计	-	-	-	-	33,039,142.45	33,039,142.45
利率敏感度缺口	79,844,239.42	263,370,219.19	18,966,014.30	3,267,673.64	4,301,780,003.35	4,667,228,149.90

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

## 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率+1%	-416,450.01	-453,550.45
	市场利率-1%	421,196.24	458,319.39

注：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，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

## 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，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其他价格风险，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，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

## 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	18,058,943.09	0.66	135,950,055.15	2.91
交易性金融资产—基金投资	2,489,413,540.09	90.88	4,173,447,621.73	89.42
交易性金融资产—债券投资	169,858,833.35	6.20	285,603,907.13	6.12
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	2,677,331,316.53	97.75	4,595,001,584.01	98.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准+10%	258,507,226.33	374,983,651.30
	业绩比较基准-10%	-258,507,226.33	-374,983,651.30

注：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。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,506,072,716.45	4,282,309,068.71
第二层次	153,199,656.99	263,792,086.81
第三层次	18,058,943.09	48,900,428.49
合计	2,677,331,316.53	4,595,001,584.01

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2022 年 12 月 31 日：无）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 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	18,058,943.09	0.65
	其中：股票	18,058,943.09	0.65
2	基金投资	2,489,413,540.09	89.56

3	固定收益投资	169,858,833.35	6.11
	其中：债券	169,858,833.35	6.11
	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	-12,021.92	-0.00
	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	58,020,649.98	2.09
8	其他各项资产	44,353,744.41	1.60
9	合计	2,779,693,689.00	100.00

## 7.2 报告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	-	-
C	制造业	13,112,851.58	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,189,614.95	0.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,173,409.02	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,583,067.54	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,058,943.09	0.66

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300442	润泽科技	102,215	3,025,564.00	0.11
2	002865	钧达股份	20,000	2,770,200.00	0.10
3	601778	晶科科技	451,467	2,189,614.95	0.08
4	002765	蓝黛科技	252,845	2,032,873.80	0.07
5	002487	大金重工	53,547	1,634,254.44	0.06
6	300020	银江技术	184,722	1,583,067.54	0.06
7	603936	博敏电子	112,616	1,287,200.88	0.05
8	603912	佳力图	127,854	1,213,334.46	0.04
9	000701	厦门信达	192,678	1,173,409.02	0.04
10	601500	通用股份	287,356	1,149,424.00	0.04

## 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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002765	蓝黛科技	2,000,003.95	0.04
2	300442	润泽科技	2,000,002.92	0.04
3	002865	钧达股份	2,000,000.00	0.04
4	601778	晶科科技	1,999,998.81	0.04
5	300020	银江技术	1,329,998.40	0.03
6	603936	博敏电子	1,329,994.96	0.03
7	601500	通用股份	999,998.88	0.02
8	000701	厦门信达	999,998.82	0.02
9	603912	佳力图	999,997.80	0.02
10	600925	苏能股份	55,372.80	0.00
11	001311	多利科技	30,873.13	0.00
12	603281	江瀚新材	30,714.17	0.00
13	001314	亿道信息	17,780.00	0.00
14	603190	亚通精工	13,672.30	0.00
15	601121	宝地矿业	11,090.16	0.00
16	603173	福斯达	10,966.20	0.00
17	603073	彩蝶实业	10,520.50	0.00
18	001368	通达创智	8,820.63	0.00
19	603153	上海建科	8,487.80	0.00
20	603282	亚光股份	8,226.00	0.00

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例(%)
1	002617	露笑科技	6,633,995.79	0.14
2	001896	豫能控股	6,624,617.32	0.14
3	688303	大全能源	5,788,025.99	0.12
4	300496	中科创达	4,868,288.30	0.10
5	000858	五粮液	3,976,563.00	0.09
6	000568	泸州老窖	3,392,550.00	0.07
7	300760	迈瑞医疗	3,201,683.00	0.07
8	000591	太阳能	3,167,230.43	0.07
9	002624	完美世界	3,140,758.00	0.07
10	002415	海康威视	3,090,883.00	0.07
11	002108	沧州明珠	2,987,819.04	0.06
12	601899	紫金矿业	2,921,436.00	0.06
13	002053	云南能投	2,795,075.16	0.06
14	600521	华海药业	2,651,484.00	0.06
15	000001	平安银行	2,619,892.00	0.06
16	002555	三七互娱	2,596,054.04	0.06
17	603259	药明康德	2,580,126.00	0.06
18	600690	海尔智家	2,496,880.00	0.05
19	600309	万华化学	2,440,119.00	0.05
20	600570	恒生电子	2,391,651.40	0.05

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	13,903,720.67
卖出股票收入（成交）总额	142,429,568.49

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	91,618,101.37	3.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,138,849.32	2.23
	其中：政策性金融债	61,138,849.32	2.23
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）	17,101,882.66	0.62
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	169,858,833.35	6.20

## 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	220014	22 付息国债 14	900,000	91,618,101.37	3.34
2	190305	19 进出 05	600,000	61,138,849.32	2.23
3	113044	大秦转债	31,460	3,634,138.53	0.13
4	110081	闻泰转债	16,680	1,863,625.78	0.07
5	110053	苏银转债	13,230	1,663,224.85	0.06

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 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 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

本基金作为一只稳健型的养老目标 FOF 基金，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。

相对收益风险方面，本基金将从持仓角度出发，根据所投资基金最新的定期报告数据，衡量本基金与业绩比较基准在底层资产配置、行业配置等维度上的偏离方向和幅度；同时从净值角度出发，定期跟踪本基金净值相对于业绩比较基准的贝塔值、跟踪误差等指标，监控净值偏离风险。

子基金风格飘移风险方面，本基金不会持有风格不够清晰稳定的基金品种。若持仓基金因为基金经理变更或者其他原因导致基金投资风格的变化，则本基金将重新评估该基金品种或基金经理，从而决定是否继续持有该基金。

整体流动性风险方面，本基金将通过严格控制封闭运作的基金、定期开放基金等流动受限基金的投资比例，有效控制流动性风险。

### 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	006985	兴全恒裕债券 A	契约型开放式	281,450,471.62	308,216,411.47	11.25	是
2	004417	兴全货币 B	契约型开放式	201,041,375.02	201,041,375.02	7.34	是
3	040026	华安信用四季红债券 A	契约型开放式	136,935,545.45	143,837,096.94	5.25	否
4	000032	易方达信用债券 A	契约型开放式	90,461,254.58	101,660,357.90	3.71	否
5	159920	恒生 ETF	交易型开放式 (ETF)	87,188,700.00	97,389,777.90	3.56	否
6	007616	富国投资级信用债券 A	契约型开放式	87,915,691.61	90,623,494.91	3.31	否

7	513500	博时标普500ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	54,884,500.00	82,491,403.50	3.01	否
8	003327	万家鑫璟纯债债券 A	契约型开放式	66,600,568.40	81,026,251.52	2.96	否
9	002650	东方红稳添利纯债债券 A	契约型开放式	72,752,716.26	79,613,297.40	2.91	否
10	004388	鹏华丰享债券	契约型开放式	65,982,338.32	77,357,693.45	2.82	否
11	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	59,500,864.62	67,372,829.01	2.46	是
12	510900	易方达恒生国企(QDII-ETF)	交易型开放式(ETF)	81,966,700.00	65,737,293.40	2.40	否
13	006870	广发景和中短债债券 A	契约型开放式	61,689,948.69	63,633,182.07	2.32	否
14	100058	富国产业债债券 A	契约型开放式	40,885,206.66	48,722,900.78	1.78	否
15	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	12,746,519.27	48,398,533.67	1.77	否
16	008030	农银金益债券	契约型开放式	47,183,587.95	48,377,332.73	1.77	否
17	166009	中欧新动力混合(LOF)A	上市契约型开放式	15,443,083.92	46,948,519.43	1.71	否

			(LOF)				
18	009306	平安惠铭纯债债券	契约型开放式	42,292,637.69	45,967,867.91	1.68	否
19	100032	富国中证红利指数增强 A	契约型开放式	46,224,359.90	45,207,423.98	1.65	否
20	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	17,952,945.68	44,914,679.50	1.64	否
21	000186	华泰柏瑞季季红债券	契约型开放式	40,224,817.82	43,366,376.09	1.58	否
22	006874	创金合信恒兴中短债债券 A	契约型开放式	35,015,620.70	41,966,221.41	1.53	否
23	004027	广发景源纯债 A	契约型开放式	38,141,018.92	40,463,806.97	1.48	否
24	000191	富国信用债债券 A	契约型开放式	31,266,623.02	38,636,166.07	1.41	否
25	002169	永赢稳益债券	契约型开放式	32,827,450.96	36,146,306.25	1.32	否
26	163417	兴全合宜混合(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	24,099,662.00	34,662,543.85	1.27	是
27	005709	华安鼎益债券 A	契约型开放式	29,742,941.87	32,312,732.05	1.18	否
28	004681	万家安弘债券 A	契约型开放式	27,527,069.19	30,577,068.46	1.12	否

29	008482	广发央企 80 债券指数 A	契约型开放式	27,770,845.17	29,487,083.40	1.08	否
30	090007	大成策略回报混合	契约型开放式	24,063,820.24	28,274,988.78	1.03	否
31	003280	鹏华丰恒债券	契约型开放式	25,278,289.26	27,904,703.51	1.02	否
32	004614	鹏扬利泽债券 A	契约型开放式	25,621,292.81	26,979,221.33	0.98	否
33	518880	华安黄金易 (ETF)	交易型开放式 (ETF)	5,821,200.00	25,316,398.80	0.92	否
34	002245	泰康稳健增利债券 A	契约型开放式	18,700,000.02	25,278,660.03	0.92	否
35	000205	易方达投资级信用债债券 A	契约型开放式	21,421,816.77	24,806,463.82	0.91	否
36	260112	景顺长城能源基建混合	契约型开放式	11,172,625.69	23,887,073.73	0.87	否
37	002980	华夏创新前沿股票	契约型开放式	8,576,286.45	21,003,325.52	0.77	否
38	000471	富国城镇发展股票	契约型开放式	8,978,469.82	20,461,932.72	0.75	否
39	519994	长信金利趋势混合	契约型开放式	42,459,683.70	17,892,510.71	0.65	否
40	007449	兴全多维价值混合 A	契约型开	9,678,668.22	17,747,773.92	0.65	是

			放式				
41	007143	国投瑞银沪深300 指数量化增强 A	契约型开放式	13,459,167.38	16,745,896.05	0.61	否
42	163412	兴全轻资产混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	3,282,180.12	10,145,218.75	0.37	是
43	340006	兴全全球视野股票	契约型开放式	4,015,627.33	10,069,988.66	0.37	是
44	163415	兴全商业模式优选混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	3,000,027.00	9,939,089.45	0.36	是
45	110023	易方达医疗保健行业混合	契约型开放式	2,960,800.11	9,823,934.76	0.36	否
46	163409	兴全绿色投资混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	7,208,874.75	9,551,759.04	0.35	是
47	512170	华宝中证医疗 ETF	交易型开放式 (ETF)	20,204,900.00	8,546,672.70	0.31	否
48	340007	兴全社会责任混合	契约型开放式	1,805,005.17	6,866,239.67	0.25	是
49	184801	鹏华前海	上市契约型开放式	69,600.00	6,635,524.80	0.24	否

			(LOF)				
50	510500	南方中证 500ETF	交易型开放式 (ETF)	1,074,900.00	6,551,515.50	0.24	否
51	005313	万家中证 1000 指数 A	契约型开放式	4,414,902.63	5,684,628.63	0.21	否
52	169106	东证创优	上市契约型开放式 (LOF)	3,128,421.00	3,181,604.16	0.12	否
53	512990	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,675,800.00	2,533,809.60	0.09	否
54	001821	兴全天添益货币 B	契约型开放式	2,000,295.91	2,000,295.91	0.07	是
55	510170	国联安商品 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,353,000.00	1,889,459.00	0.07	否
56	512160	MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,231,000.00	1,384,875.00	0.05	否
57	515910	中金 MSCI 中国 A 股国际质量 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,607,700.00	969,443.10	0.04	否
58	159941	纳指 ETF	交易型开放式 (ETF)	624,600.00	517,168.80	0.02	否



59	506000	南方科创板 3 年定开混合	上市契约型开放式 (LOF)	579,300.00	435,054.30	0.02	否
60	162720	创业广发	上市契约型开放式 (LOF)	190,300.00	162,896.80	0.01	否
61	163407	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	30,600.00	69,385.50	0.00	是

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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的情形，未出现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是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 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	62,747.52
2	应收清算款	44,018,027.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	272,858.90
6	其他应收款	110.41
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,353,744.41

#### 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	113044	大秦转债	3,634,138.53	0.13
2	110081	闻泰转债	1,863,625.78	0.07
3	110053	苏银转债	1,663,224.85	0.06
4	128129	青农转债	1,627,787.54	0.06
5	113042	上银转债	1,455,507.41	0.05
6	123107	温氏转债	975,881.13	0.04
7	113043	财通转债	974,353.07	0.04
8	110059	浦发转债	971,749.54	0.04
9	113052	兴业转债	927,623.18	0.03
10	110067	华安转债	865,339.29	0.03
11	127056	中特转债	828,707.50	0.03
12	113065	齐鲁转债	485,868.74	0.02
13	132026	G 三峡 EB2	442,706.30	0.02
14	110085	通 22 转债	385,369.80	0.01

### 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	300442	润泽科技	3,025,564.00	0.11	非公开发行流通受限
2	002865	钧达股份	2,770,200.00	0.10	非公开发行流通受限
3	601778	晶科科技	2,189,614.95	0.08	非公开发行流通受限
4	002765	蓝黛科技	2,032,873.80	0.07	非公开发行流通受限
5	002487	大金重工	1,634,254.44	0.06	非公开发行流通受限
6	300020	银江技术	1,583,067.54	0.06	非公开发行流通受限
7	603936	博敏电子	1,287,200.88	0.05	非公开发行流通受限
8	603912	佳力图	1,213,334.46	0.04	非公开发行流通受限
9	000701	厦门信达	1,173,409.02	0.04	非公开发行流通受限
10	601500	通用股份	1,149,424.00	0.04	非公开发行流通受限

### 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

份额级别	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（%）
兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	27,108	98,376.25	7,135,701.47	0.27	2,659,647,715.70	99.73
兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y	3,963	5,598.98	-	-	22,188,755.81	100.00
合计	31,071	86,542.83	7,135,701.47	0.27	2,681,836,471.51	99.73

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	240,392.56	0.0090
	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y	31,017.71	0.1398
	合计	271,410.27	0.0101

注：“占基金总份额比例”对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

### 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情况

项目	份额级别	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	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	0
	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	0
	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF A	兴证全球安悦稳健养老一年持有混合 FOF Y
基金合同生效日 (2021 年 9 月 17 日) 基金份额总额	6,344,209,810.91	-
本报告期期初基金份额总额	4,690,160,785.04	9,534,093.30
本报告期基金总申购份额	3,313,186.46	12,654,662.51
减：本报告期基金总赎回份额	2,026,690,554.33	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,666,783,417.17	22,188,755.81

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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无重大人事变动。

(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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），因此未达到《中华人民共和国证券投资基金法》和《MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金合同》规定的关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的有效条件。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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	4	142,429,568.49	100.00	107,944.83	100.00	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	减少 2 个
中信建投 证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例 (%)

兴业 证券	8,964,052.11	100.00	40,000,000.00	100.00	-	-	200,446,785.00	100.00
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏	-	-	-	-	-	-	-	-	-



源 证 券								
太 平 洋 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天 风 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
万 联 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信 达 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
银 河 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
招 商 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 国 中 金 财 富 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中 金 公 司	-	-	-	-	-	-	-	-
中 泰 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	关于增加旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-01-03
2	关于旗下部分基金投资大金重工 (002487) 非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-01-04
3	关于增加渤海银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-01-06
4	关于增加宁波银行股份有限公司为旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-02-09
5	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资润泽科技 (300442) 非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-02-16
6	关于增加申万宏源证券为旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-02-21
7	关于旗下部分基金投资蓝黛科技 (002765) 非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-02-21
8	关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-02-28
9	关于旗下部分基金投资晶科科技 (601778) 非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-03-02
10	关于增加旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-03-22
11	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-03-23
12	关于旗下部分基金投资通用股份 (601500) 非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-03-28
13	关于增加旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-03-31
14	关于旗下部分基金投资佳力图 (603912) 非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-04-01

15	关于增加北京银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-04-04
16	关于旗下部分基金投资博敏电子（603936）非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-04-12
17	关于增加旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-04-28
18	关于在网上直销平台开展旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额申购费率优惠活动的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-05-05
19	关于旗下部分基金投资银江技术（300020）非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-05-18
20	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-06-14
21	关于旗下部分基金投资钧达股份（002865）非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-06-20
22	关于旗下部分基金投资厦门信达（000701）非公开发行股票的公告	证券日报、规定互联网网站	2023-06-30

## § 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 (%)
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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金为养老目标基金，致力于满足投资者的养老资金管理需求，但养老目标基金并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺，存在投资者承担亏损的可能性。

2、本基金每份基金份额的最短持有期限为 1 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 1 年（1 年指 365 天，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。因此,对于基金份额持有人而言,存在投资本基金后 1 年内无法赎回的风险。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；

2、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；

3、《兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；

4、关于申请募集注册兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的法律意见书；

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、中国证监会要求的其他文件。

### 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电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日