

兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型
基金中基金（FOF）
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|-------------|---|
| 基金简称 | 兴全安泰稳健养老一年持有混合 (FOF) |
| 基金主代码 | 010266 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 11 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1, 149, 508, 376. 63 份 |
| 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、债券投资策略、资产支持证券投资策略、风险控制策略等。 |
| 业绩比较基准 | 中证偏股型基金指数收益率×20%+中债综合（全价）指数收益率×80% |
| 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。 |
| 基金管理人 | 兴证全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 下属分级基金的基金简称 | 兴全安泰稳健养老一年持有 兴全安泰稳健养老一年持有 |

| | | |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| | 混合（FOF）A | 混合（FOF）Y |
| 下属分级基金的交易代码 | 010266 | 017384 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,110,637,820.11 份 | 38,870,556.52 份 |

注：1、本基金每份基金份额最短持有期为 1 年。

2、本基金于 2022 年 11 月 17 日公告增设 Y 类基金份额，代码为 017384。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|----------------------|
| | 兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）A | 兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
| 1. 本期已实现收益 | 18,524,736.37 | 642,594.03 |
| 2. 本期利润 | -6,829,387.84 | -212,662.22 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0059 | -0.0057 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1,170,718,520.28 | 41,079,023.30 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0541 | 1.0568 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.58% | 0.15% | -1.30% | 0.16% | 0.72% | -0.01% |
| 过去六个月 | -0.43% | 0.14% | -1.69% | 0.15% | 1.26% | -0.01% |
| 过去一年 | 1.83% | 0.17% | -1.39% | 0.17% | 3.22% | 0.00% |
| 自基金合同 | 5.41% | 0.19% | 0.09% | 0.23% | 5.32% | -0.04% |

| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）Y

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -0.51% | 0.15% | -1.30% | 0.16% | 0.79% | -0.01% |
| 过去六个月 | -0.28% | 0.14% | -1.69% | 0.15% | 1.41% | -0.01% |
| 自基金合同 生效起至今 | 1.99% | 0.15% | -1.00% | 0.15% | 2.99% | 0.00% |

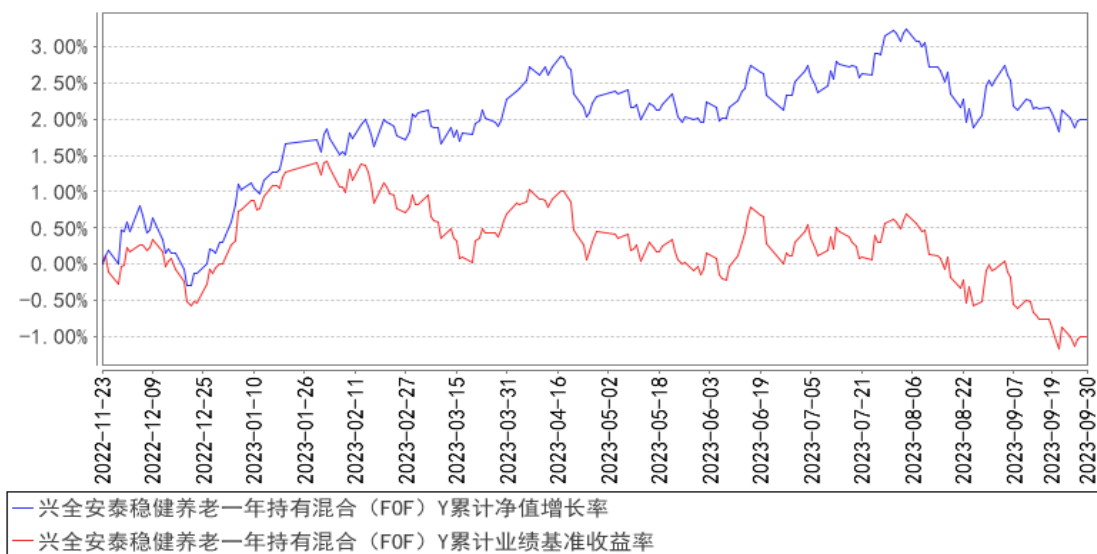
注：本基金于 2022 年 11 月 17 日公告增设 Y 类基金份额，并于 2022 年 11 月 23 日开始办理申购等相关业务。

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



兴全安泰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 09 月 30 日。

2、按照《兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2020 年 11 月 26 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘潇 | 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、兴证全球优选 | 2022 年 8 月 29 日 | - | 11 年 | 硕士。历任泰康资产管理有限责任公司基金研究员、基金投资总监，腾讯科技（北京）有限公司产品研究副总监，兴证全球基金管理有限公司投资经理。 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| 稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理、兴证全球安悦平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（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。

4.1.1 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）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度 A 股市场继续震荡下行，上证综指下跌 2.86%。市场内部分化依然明显，从主流宽基指数看，中证红利指数、上证 50 指数小幅收涨，分别上涨 1.75%、0.60%，其他宽基指数尤其是偏小市值、成长风格的指数下跌幅度较大，其中科创 50 指数、创业板指数、中证 1000 指数分别下跌 11.67%、9.53%、7.92%。从申万一级行业表现来看，金融地产相关板块表现较优，非银金融、钢铁、银行、建筑材料分别上涨 5.62%、2.14%、1.50%、1.08%，而新能源与 TMT 板块回调幅度大，电气设备、传媒、计算机、通信分别下跌 15.68%、15.58%、11.71%、10.65%。从风格指数上来看，大盘指数表现优于中盘、小盘指数，低价股指数表现优于中价、高价股指数，低市盈（净）率指数表现优于中、高市盈（净）率指数，亏损股表现优于绩优股和微利股指数。三季度债券市场波动加剧，整季来看表现相对较好，中债总财富指数、中债银行间国债财富指数、中债企业债总财富指数分别上涨 0.62%、0.60%、1.19%，中证转债指数小幅下跌 0.52%。从基金指数上看，中证偏股基金指数下跌 6.53%，中长期纯债基金指数上涨 0.55%，黄金 ETF 上涨 2.00%，以人民币计价的标普 500ETF 净值下跌 3.90%，纳斯达克 ETF 净值下跌 2.66%。

本季度基金进行了以下操作：1、权益资产端：三季度宏观数据逐步企稳，房地产行业政策以及资本市场政策陆续出台且力度较大，对于宏观经济和资本市场的稳定作用逐步显现。结合权益市场当前较低的估值的现状，我们逐步提升了权益仓位。在加仓方向上，我们侧重估值性价比更加合理，潜在改善更大的成长风格基金。2、固定收益端：由于宏观经济政策的落地，初步扭转了前期收益率持续下行的态势。我们仍然担心资金对固定收益类产品的过度拥挤可能导致此类产品的超预期波动，结合当下的收益率水平，我们将部分债基转移至货币基金。3、另类资产方面：内盘黄金受到短期供需错配影响出现较国际金价的持续溢价，我们阶段性降低黄金持仓避免价差损失。4、根据既定的策略参与股票定增、大宗交易、场内折价基金等投资机会。5、我们在组合中坚持多资产配置策略，利用大类资产之间的低相关性改善组合波动水平。权益型基金、债券型基金、商品型基金均是我们多资产配置的重要组成部分。

作为一只养老目标 FOF 产品，我们的目标是实现长期稳健的投资收益，坚持组合投资纪律以及勤勉拓展收益来源是我们实现上述目标的手段。我们希望借由我们投资目标的实现，改善持有

人的持有体验和持有收益，从而陪伴投资者实现财富增值和养老储备。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）A 份额净值为 1.0541 元，本报告期的基金份额净值收益率为-0.58%，同期业绩比较基准收益率为-1.30%，截至本报告期末兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）Y 份额净值为 1.0568 元，本报告期的基金份额净值收益率为-0.51%，同期业绩比较基准收益率为-1.30%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 15,419,925.07 | 1.27 |
| | 其中：股票 | 15,419,925.07 | 1.27 |
| 2 | 基金投资 | 1,110,972,692.60 | 91.34 |
| 3 | 固定收益投资 | 73,653,793.28 | 6.06 |
| | 其中：债券 | 73,653,793.28 | 6.06 |
| | 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 | 16,017,496.59 | 1.32 |
| 8 | 其他资产 | 223,852.71 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 1,216,287,760.25 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,393,322.75 | 0.11 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 10,951,161.49 | 0.90 |

| | | | |
|---|------------------|---------------|------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 612,312.00 | 0.05 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,463,128.83 | 0.20 |
| 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 | - | - |
| 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 | 15,419,925.07 | 1.27 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601500 | 通用股份 | 431,035 | 1,616,381.25 | 0.13 |
| 2 | 300945 | 曼卡龙 | 115,894 | 1,565,727.94 | 0.13 |
| 3 | 000629 | 钒钛股份 | 425,532 | 1,514,893.92 | 0.13 |
| 4 | 600703 | 三安光电 | 96,774 | 1,492,255.08 | 0.12 |
| 5 | 300265 | 通光线缆 | 167,464 | 1,468,659.28 | 0.12 |
| 6 | 002324 | 普利特 | 115,761 | 1,414,599.42 | 0.12 |
| 7 | 600975 | 新五丰 | 166,865 | 1,393,322.75 | 0.11 |
| 8 | 300505 | 川金诺 | 91,743 | 1,333,943.22 | 0.11 |
| 9 | 601865 | 福莱特 | 44,293 | 1,196,796.86 | 0.10 |
| 10 | 603936 | 博敏电子 | 84,674 | 913,632.46 | 0.08 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 5,935,123.59 | 0.49 |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|---------------|------|
| 3 | 金融债券 | 60,839,311.48 | 5.02 |
| | 其中：政策性金融债 | 60,839,311.48 | 5.02 |
| 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） | 6,879,358.21 | 0.57 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 73,653,793.28 | 6.08 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 210207 | 21 国开 07 | 600,000 | 60,839,311.48 | 5.02 |
| 2 | 019678 | 22 国债 13 | 59,000 | 5,935,123.59 | 0.49 |
| 3 | 113044 | 大秦转债 | 48,190 | 5,673,784.98 | 0.47 |
| 4 | 132020 | 19 蓝星 EB | 10,850 | 1,205,573.23 | 0.10 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 23,999.04 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 195,081.53 |
| 6 | 其他应收款 | 4,772.14 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 223,852.71 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 113044 | 大秦转债 | 5,673,784.98 | 0.47 |
| 2 | 132020 | 19 蓝星 EB | 1,205,573.23 | 0.10 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|---------------|
| 1 | 300945 | 曼卡龙 | 1,565,727.94 | 0.13 | 非公开发行 流通受限 |
| 2 | 000629 | 钒钛股份 | 1,514,893.92 | 0.13 | 非公开发行 流通受限 |
| 3 | 300265 | 通光线缆 | 1,468,659.28 | 0.12 | 非公开发行 |

| | | | | | |
|---|--------|------|--------------|------|---------------|
| | | | | | 流通受限 |
| 4 | 002324 | 普利特 | 1,414,599.42 | 0.12 | 非公开发行 流通受限 |
| 5 | 600975 | 新五丰 | 1,393,322.75 | 0.11 | 非公开发行 流通受限 |
| 6 | 300505 | 川金诺 | 1,333,943.22 | 0.11 | 非公开发行 流通受限 |
| 7 | 601865 | 福莱特 | 1,196,796.86 | 0.10 | 非公开发行 流通受限 |
| 8 | 603936 | 博敏电子 | 913,632.46 | 0.08 | 非公开发行 流通受限 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 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 | 107,817,102.05 | 118,857,573.30 | 9.81 | 是 |
| 2 | 003949 | 兴全稳泰债券 A | 契约型开放式 | 63,991,159.14 | 72,937,123.19 | 6.02 | 是 |
| 3 | 006804 | 富国短债债券 A | 契约型开放式 | 61,224,063.64 | 70,450,530.03 | 5.81 | 否 |
| 4 | 001821 | 兴全天添益货币 B | 契约型开放式 | 57,126,353.98 | 57,126,353.98 | 4.71 | 是 |
| 5 | 040026 | 华安信用四季红债券 A | 契约型开放式 | 53,672,367.58 | 56,237,906.75 | 4.64 | 否 |
| 6 | 003863 | 招商招祥纯债 A | 契约型开放式 | 39,597,738.03 | 43,252,609.25 | 3.57 | 否 |
| 7 | 006662 | 易方达安悦超短债债券 A | 契约型开放式 | 41,567,647.36 | 42,303,394.72 | 3.49 | 否 |
| 8 | 004417 | 兴全货币 B | 契约型开放式 | 38,171,463.75 | 38,171,463.75 | 3.15 | 是 |
| 9 | 003859 | 招商招旭纯债 A | 契约型开放式 | 28,527,998.99 | 37,785,334.66 | 3.12 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|--------------|--------|---------------|---------------|------|---|
| 10 | 002650 | 东方红稳添利纯债债券 A | 契约型开放式 | 29,250,306.48 | 31,912,084.37 | 2.63 | 否 |
|----|--------|--------------|--------|---------------|---------------|------|---|

6.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名公开募集基础设施证券投资基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日 | 其中：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 |
|----------------------|--------------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 10,137.95 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 22,479.40 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 35,094.05 | 15,270.92 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 1,480,268.37 | 327,330.82 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 331,908.29 | 83,119.35 |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）A | 兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
|---------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,229,923,786.15 | 35,220,341.23 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,057,951.11 | 3,650,215.29 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 121,343,917.15 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,110,637,820.11 | 38,870,556.52 |

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）A | 兴全安泰稳健养老一年持有混合（FOF）Y |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0 | 0 |

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期内未运用固有资金对本基金进行交易。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|--|----------------|-------------------------|------|------|------------|------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 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。 | | | | | | | |

9.2 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理财需求，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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴全安泰稳健养老目标一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、兴全安泰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全安泰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、中国证监会规定的其它文件

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

兴证全球基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日