

# 兴全多维价值混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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

送出日期：2024 年 3 月 29 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.10 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>65</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	65

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	65
8.3 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 .....	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	71
8.6 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 .....	71
8.7 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 .....	71
8.8 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 .....	71
8.9 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 .....	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.14 投资组合报告附注 .....	71
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>72</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.3 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 .....	73
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	73
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>73</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>74</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	74
11.2 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 .....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4 基金投资策略的改变 .....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>78</b>
12.1 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 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录 .....	79
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全多维价值混合型证券投资基金	
基金简称	兴全多维价值混合	
基金主代码	007449	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 6 月 12 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	
报告期末基金份额总额	2,103,577,547.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C
下属分级基金的交易代码	007449	007450
报告期末下属分级基金的份额总额	1,830,518,207.70 份	273,059,340.19 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金为混合型基金，投资策略细分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及其他品种的投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*20%+中债综合（全价）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	王小飞
	联系电话	021-20398888	021-60637103
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	021-60637228
传真		021-20398988	021-60635778
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号	北京市西城区闹市口大街 1 号

	嘉里城办公楼 28-29 楼	院 1 号楼
邮政编码	201204	100033
法定代表人	杨华辉	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
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 号浦东嘉里城办公楼 28-29 楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年		2022 年		2021 年	
	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C
本期已实现收益	- 54,090,94 6.98	- 10,123,44 4.64	152,661,6 60.25	40,384,36 5.69	439,856,9 10.71	61,378,87 9.10
本期利润	369,526,1 91.77	116,170,9 43.37	319,069,7 98.23	100,285,5 97.38	501,570,2 31.38	74,548,95 1.85
加权平均基金份额本期利润	-0.1971	-0.1803	-0.2170	-0.2758	0.4765	0.4788
本期加权平均净值利润率	-10.94%	-10.05%	-11.80%	-15.24%	26.87%	27.07%
本期基金份额净值增长率	-10.91%	-11.45%	-12.39%	-12.91%	31.10%	30.32%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	1,168,857 ,879.44	161,908,0 08.49	1,592,008 ,393.89	612,367,4 06.17	1,143,758 ,682.08	211,158,8 42.01

期末可供分配基金份额利润	0.6385	0.5929	0.8391	0.7989	0.9534	0.9217
期末基金资产净值	2,999,376,087.14	434,967,348.68	3,489,375,530.27	1,378,919,571.10	2,518,330,930.27	473,240,347.66
期末基金份额净值	1.6385	1.5929	1.8391	1.7989	2.0993	2.0656
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	63.85%	59.29%	83.91%	79.89%	109.93%	106.56%

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

兴全多维价值混合 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
过去三个月	-3.64%	1.03%	-5.09%	0.68%	1.45%	0.35%
过去六个月	-10.65%	0.96%	-8.49%	0.72%	-2.16%	0.24%
过去一年	-10.91%	0.90%	-8.77%	0.71%	-2.14%	0.19%
过去三年	2.32%	1.20%	-26.33%	0.91%	28.65%	0.29%
自基金合同生效起至今	63.85%	1.23%	-10.03%	0.92%	73.88%	0.31%

兴全多维价值混合 C

第 7 页 共 79 页

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
过去三个月	-3.79%	1.03%	-5.09%	0.68%	1.30%	0.35%
过去六个月	-10.92%	0.96%	-8.49%	0.72%	-2.43%	0.24%
过去一年	-11.45%	0.90%	-8.77%	0.71%	-2.68%	0.19%
过去三年	0.50%	1.20%	-26.33%	0.91%	26.83%	0.29%
自基金合同生效 起至今	59.29%	1.23%	-10.03%	0.92%	69.32%	0.31%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%

其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

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。

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：

$$\text{Return } t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数收益率 } t / \text{沪深 300 指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率 } t / \text{恒生指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率 } t / \text{中债综合（全价）指数收益率 } t-1 - 1)$$

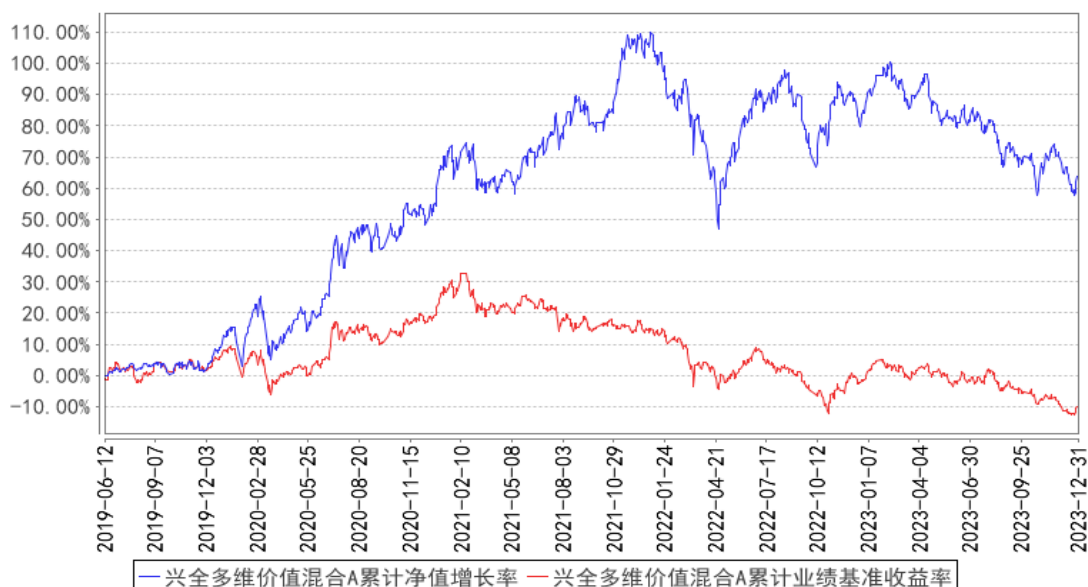
$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

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

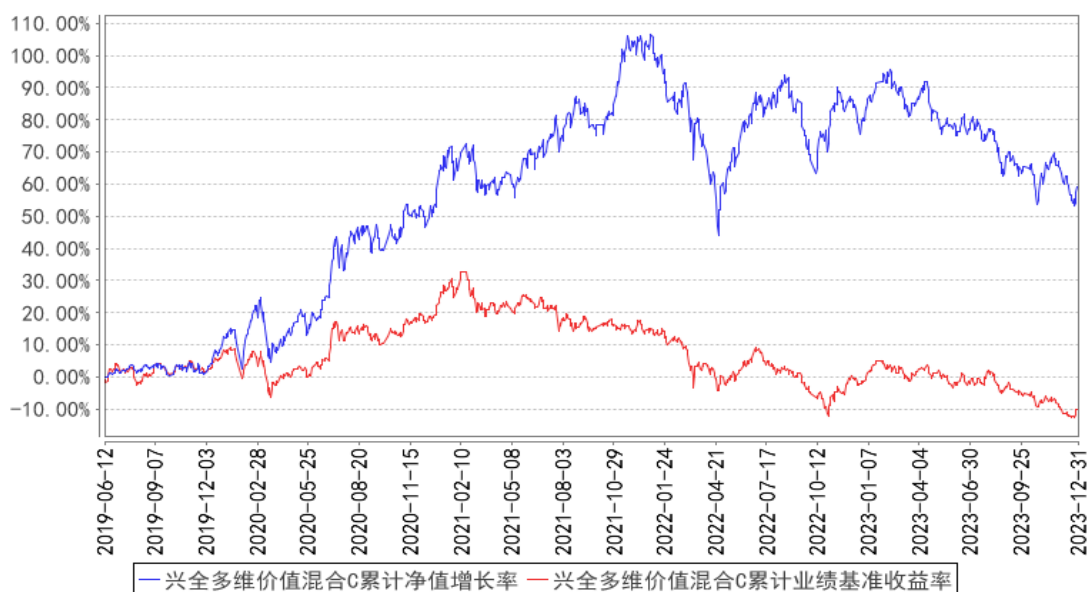


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全多维价值混合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



兴全多维价值混合C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

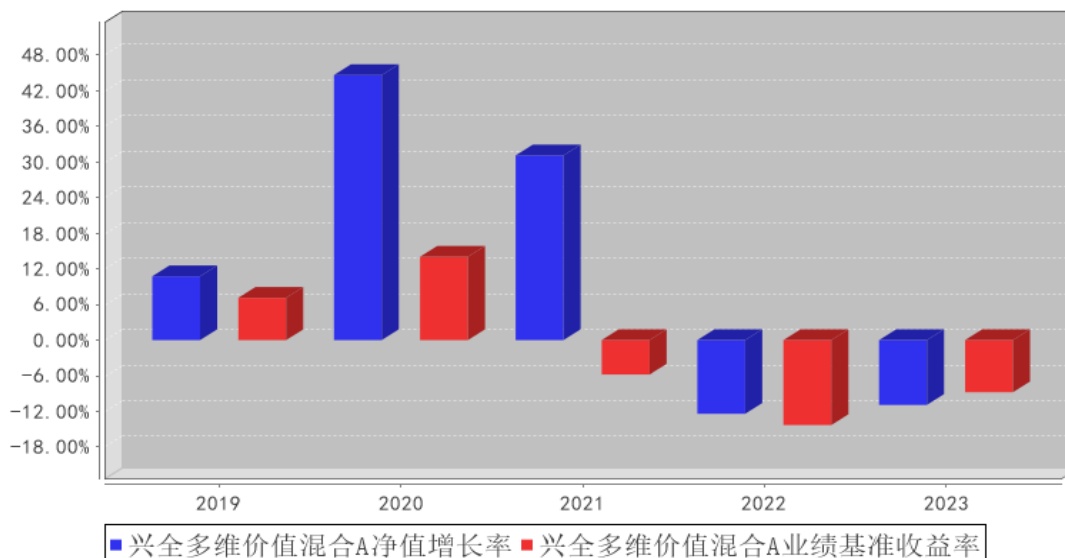


注：1、净值表现所取数据截至到 2023 年 12 月 31 日。

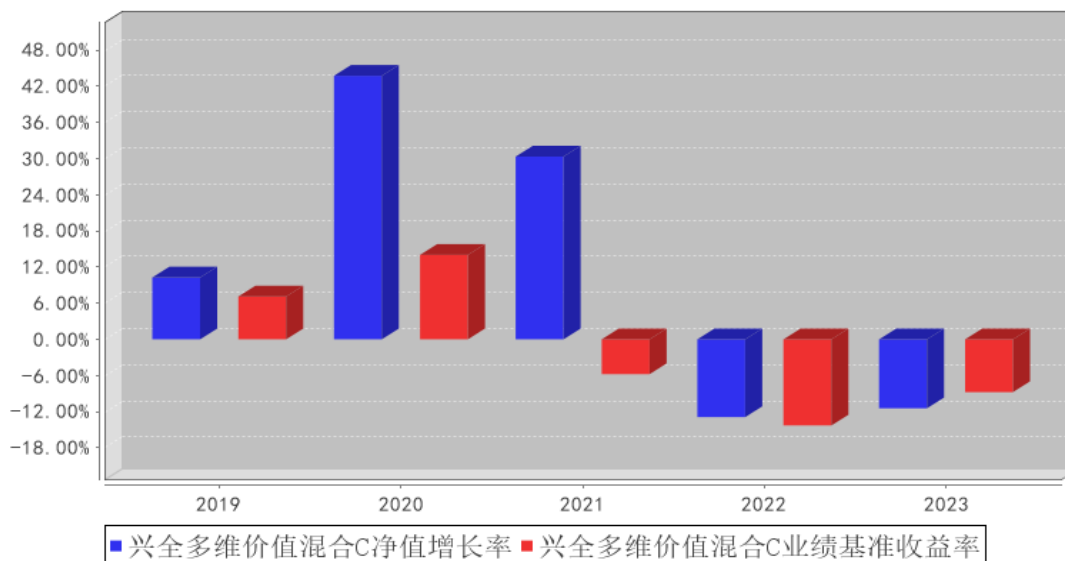
2、按照《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2019 年 06 月 12 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全多维价值混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



兴全多维价值混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2019 年数据统计期间为 2019 年 06 月 12 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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12月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共65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		
杨世进	兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全合丰三年持有混合型证券投资基金的基金经理	2021年7月16日	-	13年	硕士，历任国家知识产权局专利局审查员，招商基金管理有限公司研究员，天治基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、基金经理助理，兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 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、兴全多维价值混合型证券投资基金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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易管理办法》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

##### 4.3.3 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 年本基金持仓以科技成长为主、兼顾价值周期，继续坚持均衡分散的投资理念，选股自下而上，综合考虑公司长期成长空间、护城河、景气度及公司估值，评估公司预期收益率和投资风险，对持仓个股不断优化。23 年人工智能快速发展，针对经济社会运行的新变化，我们也在不断思考如何在投资方法上持续进化。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全多维价值混合 A 的基金份额净值为 1.6385 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.91%，同期业绩比较基准收益率为-8.77%；兴全多维价值混合 C 的基金份额净值为 1.5929 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.45%，同期业绩比较基准收益率为-8.77%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年我国全年国内生产总值 126 万亿元，比上年增长 5.2%。但是年初资本市场对经济增长的预期较高，形成了“强预期、弱现实”的投资局面。同时以新能源为代表的部分产业，由于过去几年景气度较好带来了大量产能投资，23 年竞争格局恶化导致企业盈利承压，也对相关产业的股票投资带来了压力。与此同时，很多中微观的证据，例如新能源汽车的出口、大飞机的商业化运行，也体现出经济高质量发展的进行时。虽说短期需求有压力，但我国经济的全球竞争力仍在持续提升中。

展望 2024 年，政府工作报告将经济目标增速确定在 5%左右。稳健的经济增长，将会为产业升级转型提供良好的土壤。经历了 2023 年的调整，很多优秀公司的估值都处于合理甚至低估的位置。我们将坚守合理的价格买入优秀公司的投资理念，以追求长期而稳健的回报为目标，努力为投资者带来回报。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司风险管理部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.9 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遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2401720 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全多维价值混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的兴全多维价值混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）

	<p>的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人兴证全球基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未</p>



	能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	叶凯韵 欧梦激
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号 东方广场毕马威大楼8层
审计报告日期	2024年03月27日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全多维价值混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	216,275,645.63	644,042,965.75
结算备付金		3,624,236.09	21,412,499.03
存出保证金		462,684.26	894,009.19
交易性金融资产	7.4.7.2	3,201,470,291.61	4,212,774,613.09
其中：股票投资		3,201,470,291.61	4,212,774,613.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		65,564,078.16	-
应收股利		845,113.94	-
应收申购款		1,260,487.62	27,330,067.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		3,489,502,537.31	4,906,454,154.26
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	25,642,604.62
应付赎回款		49,295,596.47	2,623,813.93
应付管理人报酬		3,596,435.76	5,759,389.80
应付托管费		599,405.96	959,898.30
应付销售服务费		237,427.65	589,372.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	6.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,430,235.65	2,583,967.61
负债合计		55,159,101.49	38,159,052.89
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	2,103,577,547.89	2,663,919,301.31
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,330,765,887.93	2,204,375,800.06
净资产合计		3,434,343,435.82	4,868,295,101.37
负债和净资产总计		3,489,502,537.31	4,906,454,154.26

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，兴全多维价值混合 A 基金份额净值 1.6385 元，基金份额总额 1,830,518,207.70 份；兴全多维价值混合 C 基金份额净值 1.5929 元，基金份额总额 273,059,340.19 份。兴全多维价值混合型证券投资基金份额总额合计为 2,103,577,547.89 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全多维价值混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-405,260,855.81	-356,901,673.46
1. 利息收入		1,724,628.39	1,704,284.69
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,724,628.39	1,704,284.69
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		12,238,589.37	251,326,965.55
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-26,519,253.19	221,447,278.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	8,929,313.29	8,055,431.43
资产支持证券 投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	29,828,529.27	21,824,255.48
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）	7.4.7.20	-421,482,743.52	-612,401,421.55
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.21	2,258,669.95	2,468,497.85
<b>减：二、营业总支出</b>		80,436,279.33	62,453,722.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	62,779,617.32	50,021,733.51
其中：暂估管理人报 酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	10,463,269.59	8,336,955.59
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,990,883.87	3,894,270.10
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		28.57	35.55
8. 其他费用	7.4.7.23	202,479.98	200,727.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-485,697,135.14	-419,355,395.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-485,697,135.14	-419,355,395.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-485,697,135.14	-419,355,395.61

### 7.3 净资产变动表

会计主体：兴全多维价值混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	2,663,919,301.31	-	2,204,375,800.06	4,868,295,101.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,663,919,301.31	-	2,204,375,800.06	4,868,295,101.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-	-
	560,341,753.42	-	873,609,912.13	1,433,951,665.55
（一）、综合收益总额	-	-	-	-
	-	-	485,697,135.14	-485,697,135.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-	-	-	-
	560,341,753.42	-	387,912,776.99	-948,254,530.41

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	1, 273, 288, 068. 89	-	1, 066, 677, 185. 50	2, 339, 965, 254. 3 9
2. 基金赎回款	- 1, 833, 629, 822. 31	-	- 1, 454, 589, 962. 49	- 3, 288, 219, 784. 8 0
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2, 103, 577, 547. 89	-	1, 330, 765, 887. 93	3, 434, 343, 435. 8 2
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	1, 428, 709, 963. 55	-	1, 562, 861, 314. 38	2, 991, 571, 277. 9 3
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 428, 709, 963. 55	-	1, 562, 861, 314. 38	2, 991, 571, 277. 9 3
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1, 235, 209, 337. 76	-	641, 514, 485. 68	1, 876, 723, 823. 4 4
(一)、综合收益总额	-	-	- 419, 355, 395. 61	-419, 355, 395. 61
(二)、本期基金份额交易产生的	1, 235, 209, 337.	-	1, 060, 869, 881.	2, 296, 079, 219. 0

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	76		29	5
其中：1. 基金申 购款	2,089,651,714. 08	-	1,766,032,075. 64	3,855,683,789.7 2
2. 基金赎 回款	- 854,442,376.32	-	- 705,162,194.35	- 1,559,604,570.6 7
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资 产减少以“-”号 填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产	2,663,919,301. 31	-	2,204,375,800. 06	4,868,295,101.3 7

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全多维价值混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予兴全多维价值混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]873 号文)的核准,由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》等相关法规和《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2019 年 6 月 12 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为 3,996,764,734.91 份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》和《兴全多维价值混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%）；每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%

#### 7.4.2 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》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本



基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### — 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### — 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益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确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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自动转为相应类别的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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关

键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”）在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所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），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 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。

##### **7.4.5.3 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。

#### **7.4.6 税项**

根据财税[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《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《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》、财税〔2014〕81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2016〕127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36号文《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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部、税务总局、中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2023〕39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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) 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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券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。

b) 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。

对证券投资基金从中国内地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，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对基金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附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	216,275,645.63	644,042,965.75
等于：本金	216,251,295.39	643,988,903.74
加：应计利息	24,350.24	54,062.01
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	216,275,645.63	644,042,965.75

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,927,608,500.82	-	3,201,470,291.61	- 726,138,209.21
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,927,608,500.82	-	3,201,470,291.61	- 726,138,209.21
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,517,430,078.78	-	4,212,774,613.09	- 304,655,465.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,517,430,078.78	-	4,212,774,613.09	-
					304,655,465.69

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末无期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末无黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无债权投资减值准备。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期内无其他债权投资减值准备。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

**7.4.7.8 其他资产**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

**7.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	93,121.81	3,105.98
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,157,113.84	2,400,861.63
其中：交易所市场	1,156,763.84	2,400,861.63
银行间市场	350.00	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	1,430,235.65	2,583,967.61

**7.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

## 兴全多维价值混合 A

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,897,367,136.38	1,897,367,136.38
本期申购	726,352,980.29	726,352,980.29
本期赎回（以“-”号填列）	-793,201,908.97	-793,201,908.97
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	1,830,518,207.70	1,830,518,207.70

## 兴全多维价值混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日
----	-----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	766,552,164.93	766,552,164.93
本期申购	546,935,088.60	546,935,088.60
本期赎回（以“-”号填列）	-1,040,427,913.34	-1,040,427,913.34
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	273,059,340.19	273,059,340.19

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 兴全多维价值混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,973,863,219.38	-381,854,825.49	1,592,008,393.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,973,863,219.38	-381,854,825.49	1,592,008,393.89
本期利润	-54,090,946.98	-315,435,244.79	-369,526,191.77
本期基金份额交易产生的变动数	-84,813,998.63	31,189,675.95	-53,624,322.68
其中：基金申购款	751,130,190.97	-150,306,729.64	600,823,461.33
基金赎回款	-835,944,189.60	181,496,405.59	-654,447,784.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,834,958,273.77	-666,100,394.33	1,168,857,879.44

##### 兴全多维价值混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	763,445,893.93	-151,078,487.76	612,367,406.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	763,445,893.93	-151,078,487.76	612,367,406.17
本期利润	-10,123,444.64	-106,047,498.73	-116,170,943.37
本期基金份额交易产生的变动数	-494,320,620.53	160,032,166.22	-334,288,454.31
其中：基金申购款	547,966,041.72	-82,112,317.55	465,853,724.17
基金赎回款	-1,042,286,662.25	242,144,483.77	-800,142,178.48
本期已分配利润	-	-	-

本期末	259,001,828.76	-97,093,820.27	161,908,008.49
-----	----------------	----------------	----------------

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	1,576,258.30	1,481,085.80
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	120,714.03	163,763.56
其他	27,656.06	59,435.33
合计	1,724,628.39	1,704,284.69

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-26,519,253.19	221,447,278.64
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	-26,519,253.19	221,447,278.64

##### 7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	6,352,259,903.33	5,498,971,934.18
减：卖出股票成本总额	6,363,557,679.72	5,260,794,553.54
减：交易费用	15,221,476.80	16,730,102.00
买卖股票差价收入	-26,519,253.19	221,447,278.64

**7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益证券出借差价收入。

**7.4.7.15 债券投资收益****7.4.7.15.1 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	42,769.41	11,353.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,886,543.88	8,044,078.25
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	8,929,313.29	8,055,431.43

**7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	64,126,985.69	57,969,363.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	55,121,104.66	49,898,394.16
减：应计利息总额	116,984.68	26,469.30
减：交易费用	2,352.47	421.85
买卖债券差价收入	8,886,543.88	8,044,078.25

**7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。



**7.4.7.16 资产支持证券投资收益****7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益申购差价收入。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股票投资产生的股利收益	29,828,529.27	21,824,255.48
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利	-	-

收益		
合计	29,828,529.27	21,824,255.48

#### 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-421,482,743.52	-612,401,421.55
股票投资	-421,482,743.52	-612,401,421.55
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	-421,482,743.52	-612,401,421.55

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	2,241,983.67	2,447,974.48
基金转换费收入	16,686.28	20,523.37
合计	2,258,669.95	2,468,497.85

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,479.98	2,727.40
账户维护费用	18,000.00	18,000.00
合计	202,479.98	200,727.40

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V)	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴证全球资本管理(上海)有限公司 (“兴证全球资本”)	基金管理人的子公司
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
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：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,648,404,111.49	13.89	1,723,530,907.83	13.39

###### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	8,217,939.84	11.11	-	-

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

### 7.4.10.1.4 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。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	1,052,424.77	13.72	220,606.59	19.07
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	1,079,626.14	13.00	23,823.99	0.99

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	62,779,617.32
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,870,707.60	13,294,885.68
应支付基金管理人的净管理费	45,908,909.72	36,726,847.83

注：2022年1月1日至2023年7月9日本基金的管理费按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，管理费的计算方法如下：

每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%/当年天数。

根据《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年7月10日起，本基金的管理费按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，管理费的计算

方法如下：

每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.20%/当年天数。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,463,269.59	8,336,955.59

注：2022年1月1日至2023年7月9日本基金的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，托管费的计算方法如下：

每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年7月10日起，本基金的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，托管费的计算方法如下：

每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月末，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全多维价值混合A	兴全多维价值混合C	合计
建设银行	-	109,746.14	109,746.14
兴业证券	-	363,146.94	363,146.94
兴证全球基金	-	2,091,824.58	2,091,824.58
合计	-	2,564,717.66	2,564,717.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全多维价值混合A	兴全多维价值混合C	合计
建设银行	-	92,783.57	92,783.57
兴业证券	-	352,192.71	352,192.71

兴证全球基金	-	1,217,217.85	1,217,217.85
合计	-	1,662,194.13	1,662,194.13

注：A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.60% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 12 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,863,583.94	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,863,583.94	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.3738%	-%

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C
基金合同生效日（2019 年 6 月 12 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	7,863,583.94	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,863,583.94	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2952%	-%

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

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。

#### 7.4.10.5.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	216,275,645.63	1,576,258.30	644,042,965.75	1,481,085.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券	688469	芯联集成	首次公开发行网下申购	137,994	785,185.86
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
000629	钒钛股份	2023 年 7 月 18 日	6 个月	非公开发行业流通受限	3.29	3.25	9,118,541	29,999,999.89	29,635,258.25	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股流通受限	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
300619	金银	2023 年	6 个月	非公	46.16	53.03	136,915	6,319,996.40	7,260,602.45	-



	河	12月28日		开发行流通受限						
300945	曼卡龙	2023年7月21日	6个月	非公开发行流通受限	12.08	13.89	827,818	10,000,041.44	11,498,392.02	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301371	敷尔佳	2023年7月24日	6个月	新股流通受限	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-

				受限							
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-	
301488	豪恩光电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-	
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股流通受限	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-	
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-	
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-	
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-	
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	

301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股流通受限	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301528	多浦乐	2023年8月17日	6个月	新股流通受限	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股流通受限	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股流通受限	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301558	三态	2023年9月	6个月	新股	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-

	股份	月 21 日		流 通 受 限						
301559	中集环科	2023年9月26日	6个月	新股流通受限	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股流通受限	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
601865	福莱特	2023年8月3日	6个月	非公开发行流通受限	29.35	26.02	851,789	25,000,007.15	22,163,549.78	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股流通受限	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603119	浙	2023	6个	新	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-

	江 荣 泰	年 7 月 21 日	月	股 流 通 受 限							
603193	润 本 股 份	2023 年 10 月 9 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
603270	金 帝 股 份	2023 年 8 月 25 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-	
603273	天 元 智 能	2023 年 10 月 16 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
603276	恒 兴 新 材	2023 年 9 月 18 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-	
603296	华 勤 技 术	2023 年 8 月 1 日	6 个 月	新 股 流 通 受 限	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-	
603313	梦 百 合	2023 年 11 月 13 日	6 个 月	非 公 开 发 行 流 通 受 限	9.38	10.08	533,049	4,999,999.62	5,373,133.92	-	

603373	安邦护卫	2023年12月13日	6个月	新股流通受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688103	国力股份	2023年10月12日	6个月	大宗交易购入流通受限	46.99	47.32	400,000	18,796,000.00	18,928,000.00	-
688347	华虹公司	2023年7月27日	6个月	新股流通受限	52.00	42.06	57,825	3,006,900.00	2,432,119.50	-
688450	光格科技	2023年7月17日	6个月	新股流通受限	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股流通受限	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-

		日		受限						
688592	司南导航	2023年8月7日	6个月	新股流通受限	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688612	威迈斯	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股流通受限	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股流通受限	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688653	康希通信	2023年11月10日	6个月	新股流通受限	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股流通受限	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-

688676	金盘科技	2023年11月6日	6个月	大宗交易购入流通受限	30.30	34.29	1,330,000	40,299,000.00	45,605,700.00	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688702	盛科通信	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间市场债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所市场债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。



## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，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、风险管理部和审计部及合规管理部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的信用债。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的信用债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为契约型开放式基金，投资者可在合同规定的交易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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 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							
货币资金	216,275,645.63	-	-	-	-	-	216,275,645.63
结算备付金	3,624,236.09	-	-	-	-	-	3,624,236.09
存出保证金	462,684.26	-	-	-	-	-	462,684.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,201,470,291.61	3,201,470,291.61
应收股利	-	-	-	-	-	845,113.94	845,113.94
应收申购款	31,990.93	-	-	-	-	1,228,496.69	1,260,487.62
应收清算款	-	-	-	-	-	65,564,078.16	65,564,078.16
资产总计	220,394,556.91	-	-	-	-	3,269,107,980.40	3,489,502,537.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	49,295,596.47	49,295,596.47
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,596,435.76	3,596,435.76
应付托管费	-	-	-	-	-	599,405.96	599,405.96
应付销售服务费	-	-	-	-	-	237,427.65	237,427.65
其他负债	-	-	-	-	-	1,430,235.65	1,430,235.65
负债总计	-	-	-	-	-	55,159,101.49	55,159,101.49
利率敏感度缺口	220,394,556.91	-	-	-	-	3,213,948,878.91	3,434,343,435.82
上年度末 2022 年 12 月 31 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							
货币资金	644,042,965.75	-	-	-	-	-	644,042,965.75
结算备付金	21,412,499.03	-	-	-	-	-	21,412,499.03
存出保证金	894,009.19	-	-	-	-	-	894,009.19
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,212,774,613.09	4,212,774,613.09
应收申购款	25,180,203.13	-	-	-	-	2,149,864.07	27,330,067.20
资产总计	691,529,677.10	-	-	-	-	4,214,924,477.16	4,906,454,154.26
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,623,813.93	2,623,813.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,759,389.80	5,759,389.80
应付托管费	-	-	-	-	-	959,898.30	959,898.30
应付清算款	-	-	-	-	-	25,642,604.62	25,642,604.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	589,372.52	589,372.52
应交税费	-	-	-	-	-	6.11	6.11

其他负债	-	-	-	-	2,583,967.61	2,583,967.61
负债总计	-	-	-	-	38,159,052.89	38,159,052.89
利率敏感度缺口	691,529,677.10	-	-	-	-4,176,765,424.27	4,868,295,101.37

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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净资产产生的影响。本报告期末及上年度末，市场利率变化对净资产无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

本报告期末基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。本报告出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	232,204,408.56	-	232,204,408.56
资产合计	-	232,204,408.56	-	232,204,408.56
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	232,204,408.56	-	232,204,408.56
项目	上年度末 2022年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	767,900,453.24	-	767,900,453.24
资产合计	-	767,900,453.24	-	767,900,453.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	767,900,453.24	-	767,900,453.24

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变		
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12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	所有外币对人民币贬值5%	-11,610,220.43	-38,395,022.66
	所有外币对人民币升值5%	11,610,220.43	38,395,022.66

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	3,201,470,291.61	93.22	4,212,774,613.09	86.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	3,201,470,291.61	93.22	4,212,774,613.09	86.53

#### 7.4.13.4.3.2 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净资产的变化		
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 (2023 年 12 月 31 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准+10%	399,238,439.28	434,898,166.15
	业绩比较基准-10%	-399,238,439.28	-434,898,166.15

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, 将对净资产产生的影响。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	3,057,955,993.88	3,991,636,332.69
第二层次	-	-
第三层次	143,514,297.73	221,138,280.40
合计	3,201,470,291.61	4,212,774,613.09

## 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	221,138,280.40	221,138,280.40
当期购买	-	242,450,915.46	242,450,915.46
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	334,513,934.08	334,513,934.08
当期利得或损失总额	-	14,439,035.95	14,439,035.95
其中：计入损益的利得或损失	-	14,439,035.95	14,439,035.95
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	143,514,297.73	143,514,297.73
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	4,565,604.98	4,565,604.98
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		

	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	138,106,951.17	138,106,951.17
当期购买	-	229,212,428.83	229,212,428.83
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	113,554,865.22	113,554,865.22
当期利得或损失总额	-	-32,626,234.38	-32,626,234.38
其中：计入损益的利得或损失	-	-32,626,234.38	-32,626,234.38
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	221,138,280.40	221,138,280.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-5,801,103.23	-5,801,103.23

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	143,514,297.73	亚式期权模型	预期波动率	0.1742-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	221,138,280.40	亚式期权模型	预期波动率	0.1772-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 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。）

#### 7.4.14.4 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。



#### 7.4.15 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。

### § 8 投资组合报告

#### 8.1 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	3,201,470,291.61	91.75
	其中：股票	3,201,470,291.61	91.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	219,899,881.72	6.30
8	其他各项资产	68,132,363.98	1.95
9	合计	3,489,502,537.31	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 232,204,408.56 元，占净值比例 6.76%。

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 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	130,737,789.80	3.81
C	制造业	2,546,605,362.56	74.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,750,576.56	0.66
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,517,929.22	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	99,298,513.60	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,734,891.25	1.19

J	金融业	39,127,444.00	1.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	18,126.06	0.00
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	78,472,192.00	2.28
	合计	2,969,265,883.05	86.46

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	43,750,017.93	1.27
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	79,473,678.39	2.31
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	108,980,712.24	3.17
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	232,204,408.56	6.76

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

### 8.3 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	688106	金宏气体	7,889,152	190,049,671.68	5.53
2	600745	闻泰科技	2,992,543	126,614,494.33	3.69
3	300408	三环集团	3,942,139	116,095,993.55	3.38
4	688103	国力股份	2,225,713	109,081,707.94	3.18
5	00700	腾讯控股	409,600	108,980,712.24	3.17
6	300718	长盛轴承	5,834,200	108,224,410.00	3.15
7	000739	普洛药业	6,456,443	99,364,657.77	2.89
8	002352	顺丰控股	2,457,884	99,298,513.60	2.89
9	600416	湘电股份	5,944,167	94,393,371.96	2.75
10	603707	健友股份	5,847,189	87,707,835.00	2.55
11	002317	众生药业	5,200,019	83,460,304.95	2.43

12	600603	广汇物流	10,086,400	78,472,192.00	2.28
13	688676	金盘科技	2,125,089	74,093,738.87	2.16
14	002985	北摩高科	2,052,078	71,166,065.04	2.07
15	002180	纳思达	3,142,885	71,123,487.55	2.07
16	000975	银泰黄金	4,692,145	70,382,175.00	2.05
17	688002	睿创微纳	1,437,315	63,558,069.30	1.85
18	688003	天准科技	1,652,603	62,005,664.56	1.81
19	603993	洛阳钼业	11,606,849	60,355,614.80	1.76
20	300806	斯迪克	3,829,351	53,878,968.57	1.57
21	002223	鱼跃医疗	1,485,900	51,382,422.00	1.50
22	600496	精工钢构	16,130,040	49,196,622.00	1.43
23	002463	沪电股份	2,117,850	46,846,842.00	1.36
24	002436	兴森科技	3,043,300	44,827,809.00	1.31
25	01928	金沙中国有限公司	2,112,800	43,750,017.93	1.27
26	02171	科济药业-B	7,348,221	43,284,181.43	1.26
27	002250	联化科技	5,956,463	42,469,581.19	1.24
28	000534	万泽股份	3,135,624	41,045,318.16	1.20
29	688728	格科微	2,002,531	40,991,809.57	1.19
30	000629	钒钛股份	12,247,262	39,897,463.13	1.16
31	300750	宁德时代	239,400	39,084,444.00	1.14
32	001301	尚太科技	1,055,461	38,650,981.82	1.13
33	688677	海泰新光	718,061	38,222,387.03	1.11
34	002045	国光电器	2,186,100	36,398,565.00	1.06
35	603606	东方电缆	809,405	34,602,063.75	1.01
36	002487	大金重工	1,288,913	34,310,864.06	1.00
37	603799	华友钴业	1,028,069	33,854,312.17	0.99
38	600586	金晶科技	4,955,368	33,101,858.24	0.96
39	603997	继峰股份	2,395,900	32,272,773.00	0.94
40	300115	长盈精密	2,414,200	31,988,150.00	0.93
41	002446	盛路通信	3,844,500	31,909,350.00	0.93
42	688048	长光华芯	503,740	31,569,385.80	0.92
43	002531	天顺风能	2,701,277	31,334,813.20	0.91
44	01548	金斯瑞生物科技	1,660,000	29,875,898.47	0.87
45	600893	航发动力	762,100	28,487,298.00	0.83
46	600498	烽火通信	1,702,300	28,326,272.00	0.82
47	688083	中望软件	270,995	26,974,842.30	0.79
48	600760	中航沈飞	629,920	26,570,025.60	0.77
49	300803	指南针	414,500	24,977,770.00	0.73
50	601600	中国铝业	4,162,960	23,479,094.40	0.68
51	600644	乐山电力	3,268,761	22,750,576.56	0.66
52	601865	福莱特	851,789	22,163,549.78	0.65
53	000063	中兴通讯	781,000	20,680,880.00	0.60

54	000938	紫光股份	1,064,900	20,605,815.00	0.60
55	000625	长安汽车	1,165,800	19,620,414.00	0.57
56	300747	锐科激光	812,962	19,128,995.86	0.56
57	600363	联创光电	549,600	18,686,400.00	0.54
58	688582	芯动联科	444,597	17,192,565.99	0.50
59	002025	航天电器	346,300	16,629,326.00	0.48
60	002384	东山精密	889,900	16,178,382.00	0.47
61	688776	国光电气	153,556	14,954,818.84	0.44
62	300033	同花顺	90,200	14,149,674.00	0.41
63	300559	佳发教育	885,000	13,717,500.00	0.40
64	300945	曼卡龙	827,818	11,498,392.02	0.33
65	002475	立讯精密	301,900	10,400,455.00	0.30
66	300619	金银河	136,915	7,260,602.45	0.21
67	002332	仙琚制药	545,300	6,963,481.00	0.20
68	06699	时代天使	123,200	6,313,598.49	0.18
69	688601	力芯微	118,081	6,186,263.59	0.18
70	603313	梦百合	533,049	5,373,133.92	0.16
71	688347	华虹公司	57,825	2,432,119.50	0.07
72	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
73	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
74	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
75	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
76	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
77	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
78	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
79	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
80	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
81	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
82	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
83	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
84	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
85	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
86	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
87	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
88	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
89	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
90	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
91	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
92	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
93	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
94	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
95	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
96	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00

97	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
98	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
99	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
100	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
101	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
102	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
103	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
104	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
105	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
106	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
107	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
108	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
109	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
110	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
111	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
112	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
113	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
114	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
115	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
116	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
117	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
118	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市 的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	600009	上海机场	135,150,049.97	2.78
2	603993	洛阳钼业	102,987,638.51	2.12
2	03993	洛阳钼业	13,054,054.56	0.27
3	002837	英维克	115,126,430.19	2.36
4	688041	海光信息	109,944,824.78	2.26
5	00700	腾讯控股	98,674,492.48	2.03
6	000975	银泰黄金	97,979,494.22	2.01
7	688676	金盘科技	87,283,757.73	1.79
8	000629	钒钛股份	86,984,555.07	1.79
9	600728	佳都科技	84,991,581.84	1.75
10	002050	三花智控	84,702,945.74	1.74
11	688103	国力股份	83,245,552.21	1.71
12	688003	天准科技	78,952,696.62	1.62
13	002045	国光电器	76,872,583.72	1.58

14	600938	中国海油	72,989,823.92	1.50
15	300806	斯迪克	72,077,655.62	1.48
16	001301	尚太科技	69,280,840.70	1.42
17	002436	兴森科技	67,891,391.00	1.39
18	002317	众生药业	66,492,873.71	1.37
19	002130	沃尔核材	65,965,167.95	1.35
20	600416	湘电股份	64,656,618.00	1.33

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	00902	华能国际电力股份	240,274,779.58	4.94
2	002405	四维图新	137,161,988.11	2.82
3	601233	桐昆股份	132,228,579.83	2.72
4	603501	韦尔股份	131,613,084.85	2.70
5	002837	英维克	129,814,611.24	2.67
6	002493	荣盛石化	125,220,097.84	2.57
7	603993	洛阳钼业	109,809,883.00	2.26
7	03993	洛阳钼业	14,888,911.13	0.31
8	03690	美团-W	122,780,029.05	2.52
9	00836	华润电力	120,049,993.92	2.47
10	688041	海光信息	120,026,576.98	2.47
11	300474	景嘉微	110,405,441.47	2.27
12	600406	国电南瑞	107,101,468.68	2.20
13	600009	上海机场	105,865,452.70	2.17
14	300487	蓝晓科技	103,535,903.18	2.13
15	600309	万华化学	102,662,644.40	2.11
16	002050	三花智控	96,183,016.02	1.98
17	601012	隆基绿能	93,669,670.93	1.92
18	00700	腾讯控股	91,502,093.74	1.88
19	600316	洪都航空	88,803,647.57	1.82
20	600728	佳都科技	88,470,841.08	1.82

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。

#### 8.4.3 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	5,773,736,101.76
卖出股票收入（成交）总额	6,352,259,903.33

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

### 8.6 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

无。

### 8.7 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。

### 8.8 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：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	462,684.26
2	应收清算款	65,564,078.16
3	应收股利	845,113.94
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,260,487.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,132,363.98

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 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	688103	国力股份	18,928,000.00	0.55	大宗交易购入 流通受限

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
兴全多维价值混合 A	175,465	10,432.38	498,473,064.20	27.23	1,332,045,143.50	72.77
兴全多维价值混合 C	39,954	6,834.34	73,917,611.10	27.07	199,141,729.09	72.93
合计	215,419	9,765.05	572,390,675.30	27.21	1,531,186,872.59	72.79

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（即期末基金份额总数）。

## 9.2 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	兴全多维价值混合 A	9,318,693.57	0.5091
	兴全多维价值混合 C	704,716.98	0.2581
	合计	10,023,410.55	0.4765

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）。

## 9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	兴全多维价值混合 A	>100
	兴全多维价值混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全多维价值混合 A	50~100
	兴全多维价值混合 C	0
	合计	50~100

## 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全多维价值混合 A	兴全多维价值混合 C
基金合同生效日（2019年6月12日）基金份额总额	3,589,840,991.70	406,923,743.21
本报告期期初基金份额总额	1,897,367,136.38	766,552,164.93
本报告期基金总申购份额	726,352,980.29	546,935,088.60
减：本报告期基金	793,201,908.97	1,040,427,913.34

总赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,830,518,207.70	273,059,340.19

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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) 报告期内本基金基金管理人无重大人事变动。

(2) 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2019 年起连续 5 年聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 60,000.00 元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	

			(%)		(%)	
中信建投 证券	2	2,586,579,2 11.85	21.80	1,665,083.9 6	21.71	-
兴业证券	3	1,648,404,1 11.49	13.89	1,052,424.7 7	13.72	-
华泰证券	2	1,601,652,2 36.51	13.50	1,014,831.6 1	13.23	-
东方财富	2	1,573,071,7 88.41	13.26	697,831.73	9.10	-
中金公司	1	928,686,732 .69	7.83	602,558.50	7.86	-
西部证券	2	703,927,638 .53	5.93	457,436.43	5.96	-
长江证券	1	605,294,075 .72	5.10	565,625.30	7.37	-
海通证券	1	461,740,956 .69	3.89	292,039.02	3.81	-
国泰君安	1	439,730,684 .42	3.71	413,354.81	5.39	-
东方证券	2	422,959,825 .18	3.56	272,364.03	3.55	-
华鑫证券	1	328,470,234 .98	2.77	209,393.99	2.73	-
申万宏源 证券	2	230,246,884 .51	1.94	185,380.07	2.42	-
东北证券	1	131,067,705 .43	1.10	82,743.17	1.08	-
银河证券	1	97,013,075. 01	0.82	90,663.02	1.18	-
国都证券	2	94,727,325. 56	0.80	59,802.96	0.78	-
中泰证券	1	12,998,714. 00	0.11	8,206.60	0.11	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-

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。

#### 11.7.2 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 (%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	8,217,939.84	11.11	-	-	-	-
华泰证券	7,777,403.85	10.52	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
中金公司	2,505,489.06	3.39	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	7,998,984.77	10.82	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	47,449,806.47	64.17	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

华信证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	证券时报、指定互联网网站	2023-01-04
2	兴全多维价值混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入公告	证券时报、指定互联网网站	2023-01-20
3	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资宏华数科(688789)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-02-11
4	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	证券时报、指定互联网网站	2023-02-16
5	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	证券时报、指定互联网网站	2023-02-21
6	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	证券时报、指定互联网网站	2023-02-28
7	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	证券时报、指定互联网网站	2023-03-10
8	关于旗下部分基金投资新诺威(300765)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-03-11
9	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资美格智能(002881)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-03-21
10	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	证券时报、指定互联网网站	2023-03-23
11	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	证券时报、指定互联网网站	2023-03-28
12	关于旗下部分基金投资佳力图(603912)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-04-01
13	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	证券时报、指定互联网网站	2023-04-12
14	关于旗下部分基金投资华依科技(688071)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-05-05
15	关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-05-05
16	关于旗下部分基金投资南化股份(600301)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-05-10
17	关于增加上海农村商业银行股份有	证券时报、指定互联网网站	2023-05-15

	限公司为旗下部分基金销售机构的公告	网站	
18	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-06-14
19	关于增加兴全多维价值混合型证券投资基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-06-29
20	兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-07-08
21	关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-07-10
22	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金基金合同、招募说明书更新的提示性公告	证券时报、指定互联网网站	2023-07-10
23	关于旗下部分基金投资钒钛股份(000629)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-07-20
24	关于旗下部分基金投资曼卡龙(300945)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-07-25
25	关于旗下部分基金投资福莱特(601865)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-08-05
26	关于开通我司旗下基金在腾安基金基金转换业务的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-08-11
27	关于增加东莞银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-09-07
28	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-10-25
29	关于旗下部分基金投资梦百合(603313)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-11-15
30	关于旗下部分基金投资金银河(300619)非公开发行股票的公告	证券时报、指定互联网网站	2023-12-30

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金的基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日起基金管理费率自 1.50%降低至 1.20%，托管费费率自 0.25%降低至 0.20%。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全多维价值混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴全多维价值混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、关于申请募集兴全多维价值混合型证券投资基金之法律意见；
- 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。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 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

兴证全球基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日