

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金(FOF) 2026 年中期报告

2026 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：2026 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	46

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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 本报告期投资基金情况	46
7.13 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 盈利投资者数量占比	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	59
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	60
10.9 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF)	
基金主代码	006580	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日	
基金管理人	兴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	495,681,034.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y
下属分级基金的交易代码	006580	017672
报告期末下属分级基金的份额总额	440,609,933.59 份	55,071,100.42 份

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 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，本基金定位为平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值。主要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、权证投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、风险控制策略、公募 REITs 投资策略等。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

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
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张姗
	联系电话	021-20398888	400-61-95555
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	400-61-95555
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	庄园芳	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	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人住所

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	上海市浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 层

§ 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y
本期已实现收益	33,139,626.70	3,776,990.37
本期利润	58,794,962.62	6,871,062.24
加权平均基金份额 本期利润	0.1307	0.1314
本期加权平均净 值利润率	6.93%	6.90%
本期基金份额净 值增长率	7.14%	7.24%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	263,410,191.27	33,730,149.89
期末可供分配基 金份额利润	0.5978	0.6125

期末基金资产净值	860,538,356.25	108,479,915.07
期末基金份额净值	1.9531	1.9698
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	95.31%	31.10%

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

兴全安泰平衡养老三年持有混合（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
过去三个月	7.03%	0.62%	11.97%	0.74%	-4.94%	-0.12%
过去六个月	7.14%	0.61%	11.35%	0.69%	-4.21%	-0.08%
过去一年	19.91%	0.58%	23.19%	0.62%	-3.28%	-0.04%
过去三年	26.88%	0.62%	26.01%	0.61%	0.87%	0.01%
过去五年	22.10%	0.57%	9.79%	0.59%	12.31%	-0.02%
过去七年	77.12%	0.58%	53.01%	0.61%	24.11%	-0.03%
自基金合同生效起至今	95.31%	0.59%	68.78%	0.62%	26.53%	-0.03%

兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

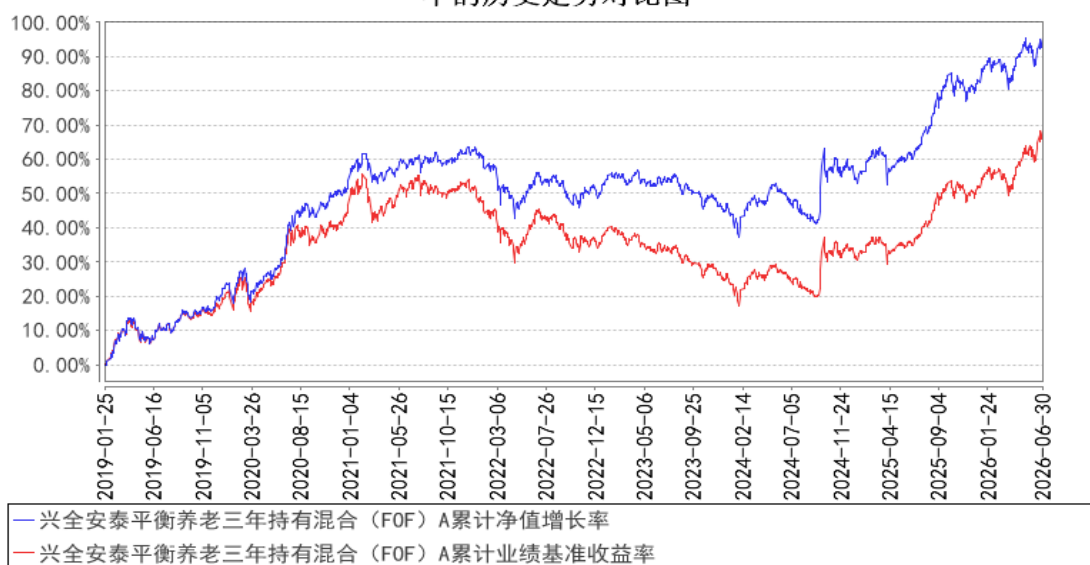
过去三个月	7.08%	0.62%	11.97%	0.74%	-4.89%	-0.12%
过去六个月	7.24%	0.61%	11.35%	0.69%	-4.11%	-0.08%
过去一年	20.15%	0.58%	23.19%	0.62%	-3.04%	-0.04%
过去三年	27.78%	0.62%	26.01%	0.61%	1.77%	0.01%
自基金合同生效 起至今	31.10%	0.59%	24.69%	0.58%	6.41%	0.01%

注：1、本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%，是根据基金合同中投资策略及资产配置比例等相关规定构建，能够较好地反映本基金的风险收益特征。本基金每个交易日对业绩比较基准依据合同约定的权重比例进行再平衡处理，并用每日连乘方式计算得到指数基准的时间序列。

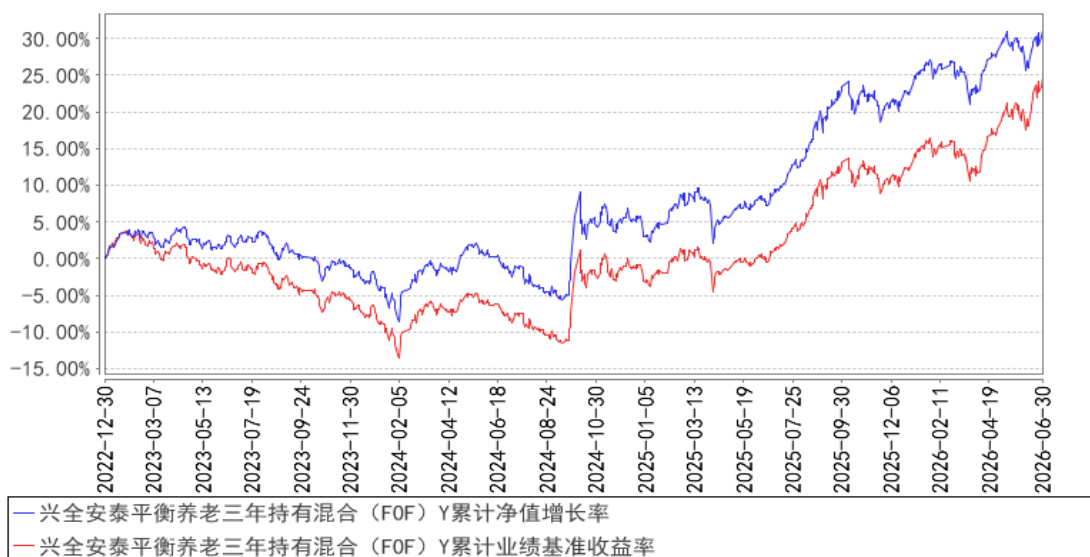
2、本基金 Y 类基金份额于 2022 年 12 月 30 日开始运作。

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

兴全安泰平衡养老三年持有混合（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



兴全安泰平衡养老三年持有混合（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 2026 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2019 年 01 月 25 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投资组合的比例范围。

3、本基金 Y 类份额于 2022 年 12 月 30 日开始运作。

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“兴证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 2026 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 89 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	总经理助理、多元资产配置部总监、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、兴全安泰积极养老五年持有混合发起式 FOF、兴全优选平衡三个月持有混合 FOF、兴全安悦稳健养老目标一年持有混合 FOF、兴全积极配置混合 FOF-LOF、兴全盈鑫多元配置三个月持有混合 FOF 基金	2019 年 1 月 25 日	-	19 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一年持有混合 FOF 基金经理、兴全优选稳健六个月持有债券 FOF、兴全优选积极三个月持有混合 FOF 基金经理。

	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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

2026 年上半年，A 股权益市场呈现成长风格显著占优的结构性特征，科技成长板块大幅领涨，科创板、创业板表现远好于大盘价值类指数。具体指数方面，上证指数受金融、传统行业权重拖累仅上涨 3.16%，而以科技成长风格为代表的创业板指大涨 35.58%，科创 50 指数更大幅上涨 64.25%；大小盘分化同样明显，代表中盘的中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，显著

优于代表大盘蓝筹的沪深 300 的 7.55%。万得全 A 指数上涨 11.52%，而中证偏股基金指数上涨 22.19%，主动管理在结构性牛市中超额收益显著。行业层面，代表 AI 产业链的电子、通信分别上涨 85.49%和 74.54%，而食品饮料、农林牧渔、商贸零售等消费类行业跌幅普遍超过 15%。整体而言，上半年 A 股的核心矛盾在于 AI 产业革命深化带来的结构性机遇与宏观经济内需偏弱之间的张力，资金高度集中于科技主线，形成了“指数涨、多数个股跌”的极端分化格局。海外权益市场方面，标普 500 指数和纳斯达克 100 指数分别上涨 9.55%和 19.91%。固定收益类资产部分，中债总财富指数上涨 1.98%，中长期纯债指数上涨 1.49%，中证转债指数上涨 2.51%。另类资产方面，中证 REITs 全收益指数下跌 3.89%，大商所豆粕期货指数上涨 3.37%，黄金先涨后跌，上半年累计下跌 9.8%。

回顾 2026 上半年，组合的主要操作有：

1. 资产配置方面：上半年，随着股票市场的快速上涨，尤其在二季度涨幅过快，组合在上涨中逐步降低仓位至欠配。

2. A 股风格方面：年初，组合呈现成长型基金略超配的状态，上半年随着成长和价值风格表现进一步分化、成长相对价值的估值倍数达到极端值，组合逢高逐步降低成长、小盘风格的基金配置比例，提升质量型、价值型基金的配置比例。

3. 基金品种方面：我们在极端市场环境下进一步谨慎审视持仓的基金品种，对风格出现漂移的基金经理进行了减仓；并且增加了部分从 PB-ROE 角度出发构建组合的基金经理的配置比例。

4. 固定收益资产：鉴于国内债券收益率偏低，主要采用海外债券型基金、内部货币及短债基金等进行替代。此外，我们观察到今年以来新股涨幅超预期，且未来有超级大盘股上市或导致新股收益增强明显，因此组合适度增加部分受益于新股贡献的固收+品种。

5. 海外及商品资产：主要以 ETF、指数基金配置为主，旨在获取多样化 β ，同时，根据场内 QDII 基金溢价变化，进行了相关品种的替换捕捉 α 机会。

6. 其他策略性操作：继续根据既定策略积极参与定增、折价品种等套利投资机会，卖出解禁的定增股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A 的基金份额净值为 1.9531 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.14%，同期业绩比较基准收益率为 11.35%；兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y 的基金份额净值为 1.9698 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.24%，同期业绩比较基准收益率为 11.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，经过七月份以来市场的快速回调和成长风格向价值风格的适度切换，目前市场的极致程度有所缓和，估值水平也有一定程度的回归。虽然权益市场整体估值依然处于高于历史中枢的水平，但长期来看，鉴于目前国内无风险收益率依然偏低，未来权益市场的整体估值中枢水平相较于以往系统性提升的可能性也比较高，所以我们整体对权益资产维持中性观点。风格方面，成长相对价值的估值倍数仍然处于历史极高位置，自 2024 年 9 月 24 日行情以来，成长风格相对价值风格的累计超额已经超过 2021 年那一轮成长行情的最高点，另外，从基金二季报的持仓情况以及主流指数的行业分布来看，科技板块目前配置比例都已经非常高、几乎处于历史极端位置，如果在短期并没有大规模的增量资金流入的情况下，情绪面或基本面的些许扰动都可能会导致行情的波动加大。因此，对于成长风格，我们仍然维持偏谨慎的观点。

未来的投资方向上，组合会依然保持“略偏左侧”和“适度均衡”的配置方式，在资金较为拥挤的方向上保持适度低配，继续挖掘市场上具有稳定的投资风格和长期可持续盈利模式的基金品种纳入组合。

本基金是一只平衡型的养老目标基金，权益类资产的配置中枢为 50%，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守基金合同要求、保持策略的稳定性，兼顾长期收益率和改善持有人体验，力争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》、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 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遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本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：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	26,441,237.34	15,855,838.04
结算备付金		20,568.79	4,170.73

存出保证金		5,654.69	8,816.86
交易性金融资产	6.4.7.2	943,077,057.47	910,183,895.42
其中：股票投资		6,680,656.25	5,774,626.09
基金投资		887,905,541.37	855,747,504.59
债券投资		48,490,859.85	48,661,764.74
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	-	-1,254.79
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		788,318.02	8,001,566.84
应收股利		-	-
应收申购款		2,753,734.66	2,176,727.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	14,647.71	5,886.22
资产总计		973,101,218.68	936,235,646.70
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
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		3,647,946.28	5,134,327.38
应付管理人报酬		205,408.12	212,513.63
应付托管费		82,235.15	85,840.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		56,695.73	12,901.62
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	90,662.08	177,934.09
负债合计		4,082,947.36	5,623,517.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	495,681,034.01	510,131,009.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	473,337,237.31	420,481,119.76

净资产合计		969,018,271.32	930,612,129.64
负债和净资产总计		973,101,218.68	936,235,646.70

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A 基金份额净值 1.9531 元，基金份额总额 440,609,933.59 份；兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y 基金份额净值 1.9698 元，基金份额总额 55,071,100.42 份。兴全安泰平衡养老三年持有混合(FOF) 份额总额合计为 495,681,034.01 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		67,528,482.65	39,910,488.75
1. 利息收入		35,016.62	37,320.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	33,798.39	31,982.31
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		1,218.23	5,338.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-” 填列）		38,663,490.76	-2,355,096.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	901,728.76	335,511.82
基金投资收益	6.4.7.15	32,756,879.97	-4,362,487.00
债券投资收益	6.4.7.16	361,207.30	368,636.22
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	4,643,674.73	1,303,242.22
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	28,749,407.79	42,226,669.70
4. 汇兑收益（损失以 “-” 号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 22	80, 567. 48	1, 595. 03
减：二、营业总支出		1, 862, 457. 79	2, 446, 441. 82
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 239, 197. 25	1, 722, 509. 74
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	497, 574. 49	610, 674. 43
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		29, 123. 25	9, 380. 72
8. 其他费用	6. 4. 7. 25	96, 562. 80	103, 876. 93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		65, 666, 024. 86	37, 464, 046. 93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65, 666, 024. 86	37, 464, 046. 93
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		65, 666, 024. 86	37, 464, 046. 93

6.3 净资产变动表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	510, 131, 009. 88	-	420, 481, 119. 76	930, 612, 129. 64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	510, 131, 009. 88	-	420, 481, 119. 76	930, 612, 129. 64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-14, 449, 975. 87	-	52, 856, 117. 55	38, 406, 141. 68
(一)、综合收益	-	-	65, 666, 024. 86	65, 666, 024. 86

总额				
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-14,449,975.87	-	-12,809,907.31	-27,259,883.18
其中：1. 基金申购款	46,745,852.08	-	41,616,842.13	88,362,694.21
2. 基金赎回款	-61,195,827.95	-	-54,426,749.44	-115,622,577.39
(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	495,681,034.01	-	473,337,237.31	969,018,271.32
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	667,383,988.68	-	379,640,867.87	1,047,024,856.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	667,383,988.68	-	379,640,867.87	1,047,024,856.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-96,283,057.44	-	-20,132,902.77	-116,415,960.21
(一)、综合收益总额	-	-	37,464,046.93	37,464,046.93
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-96,283,057.44	-	-57,596,949.70	-153,880,007.14

“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	21,973,849.21	-	13,109,990.77	35,083,839.98
2. 基金赎回款	- 118,256,906.65	-	-70,706,940.47	-188,963,847.12
(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	571,100,931.24	-	359,507,965.10	930,608,896.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>庄园芳</u>	<u>詹鸿飞</u>	<u>詹鸿飞</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (以下简称“本基金”), 经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 注册的批复》(证监许可[2018]1665 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》等相关法律法规和《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》发售, 基金合同于 2019 年 1 月 25 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 628,976,962.65 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, 基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括 QDII 基金、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上市的股票及存托凭证)、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、

中小企业私募债、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。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。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金的权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 50%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 50%的混合型基金。同时，股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 60%。本基金持有单只基金，其市值不高于本基金资产净值的 20%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；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：中证偏股型基金指数收益率 $\times$ 50%+中债综合（全价）指数收益率 $\times$ 50%。

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》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2026 年 06 月 30 日的财务状况、自 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

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》、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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起, 对在该日期之后 (含当日) 新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入, 恢复征收增值税, 对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券 (含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分) 的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务, 以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、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。

对投资者从本基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司 (“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。对本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。

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

d) 本基金卖出股票按 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。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税, 分别按照本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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	26,441,237.34
等于：本金	26,438,974.96
加：应计利息	2,262.38
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	26,441,237.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,307,584.60	-	6,680,656.25	373,071.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	18,291,281.00	166,658.89	18,469,448.89	11,509.00
	银行间市场	29,980,140.00	42,410.96	30,021,410.96	-1,140.00
	合计	48,271,421.00	209,069.85	48,490,859.85	10,369.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		748,267,793.02	-	887,905,541.37	139,637,748.35
其他		-	-	-	-
合计		802,846,798.62	209,069.85	943,077,057.47	140,021,189.00

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：本基金本报告期末无衍生金融资产/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合约。

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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 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

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未发生其他债权投资减值准备。

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

注：本基金本报告期末无其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	—
其他应收款	14,647.71
待摊费用	—
合计	14,647.71

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	6.72
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,852.80
其中：交易所市场	1,627.80
银行间市场	225.00

应付利息	-
预提费用	88,802.56
合计	90,662.08

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	463,763,737.29	463,763,737.29
本期申购	36,844,849.81	36,844,849.81
本期赎回（以“-”号填列）	-59,998,653.51	-59,998,653.51
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	440,609,933.59	440,609,933.59

兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	46,367,272.59	46,367,272.59
本期申购	9,901,002.27	9,901,002.27
本期赎回（以“-”号填列）	-1,197,174.44	-1,197,174.44
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	55,071,100.42	55,071,100.42

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

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴全安泰平衡养老三年持有混合（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	243,460,197.54	138,218,016.39	381,678,213.93
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	243,460,197.54	138,218,016.39	381,678,213.93

本期利润	33,139,626.70	25,655,335.92	58,794,962.62
本期基金份额交易产生的变动数	-13,189,632.97	-7,355,120.92	-20,544,753.89
其中：基金申购款	21,359,736.30	11,424,096.20	32,783,832.50
基金赎回款	-34,549,369.27	-18,779,217.12	-53,328,586.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	263,410,191.27	156,518,231.39	419,928,422.66

兴全安泰平衡养老三年持有混合（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	24,908,692.84	13,894,212.99	38,802,905.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	24,908,692.84	13,894,212.99	38,802,905.83
本期利润	3,776,990.37	3,094,071.87	6,871,062.24
本期基金份额交易产生的变动数	5,044,466.68	2,690,379.90	7,734,846.58
其中：基金申购款	5,757,067.00	3,075,942.63	8,833,009.63
基金赎回款	-712,600.32	-385,562.73	-1,098,163.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,730,149.89	19,678,664.76	53,408,814.65

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	33,307.61
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	23.73
其他	467.05
合计	33,798.39

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	901,728.76
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	901,728.76

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,909,956.38
减：卖出股票成本总额	5,002,134.17
减：交易费用	6,093.45
买卖股票差价收入	901,728.76

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股票投资收益证券出借差价收入。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	110,087,250.15
减：卖出/赎回基金成本总额	77,076,050.97
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	241,693.47
减：交易费用	12,625.74
基金投资收益	32,756,879.97

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	321,196.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	40,011.00
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	361,207.30

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	36,223,089.86

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成本总额	35,659,764.00
减：应计利息总额	523,089.86
减：交易费用	225.00
买卖债券差价收入	40,011.00

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益赎回差价收入。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益申购差价收入。

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买卖权证差价收入。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	24,621.77
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	4,619,052.96
合计	4,643,674.73

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	28,749,407.79
股票投资	-399,420.27
债券投资	-16,607.00
资产支持证券投资	-
基金投资	29,165,435.06
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	28,749,407.79

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
其他	80,567.48
合计	80,567.48

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	82,183.84
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	3,219,043.21
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	587,292.22

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行费用	3,260.24
账户维护费用	9,000.00
合计	96,562.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

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、关联关系

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、注册登记机构、基金销售机构
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：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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	5,909,956.38	100.00	1,846,457.13	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	5,696,411.00	100.00	4,606,726.00	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	-	-	5,000,000.00	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	30,185,570.30	100.00	39,966,934.10	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 2026年1月1日至2026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	2,635.14	100.00	1,627.80	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	823.31	100.00	823.31	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,239,197.25	1,722,509.74
其中：应支付销售机构的客户维 护费	910,528.87	952,019.08
应支付基金管理人的净管理费	328,668.38	770,490.66

注：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) A 的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50%的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费，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 A 类基金管理费=A 类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）×0.50%/当年天数；

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费，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 Y 类基金管理费=Y 类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）×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	497,574.49	610,674.43

注：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) A 的基金托管费按前一日基金资产

净值的 0.15% 的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费，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 A 类基金托管费 = A 类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；

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) Y 的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.075% 的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费，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 Y 类基金托管费 = Y 类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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	兴全安泰平衡养老三年持有 混合 (FOF) Y
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,000,350.04	—
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	10,000,350.04	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.0175%	—%
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	兴全安泰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y
基金合同生效日 (2019 年 1 月 25 日) 持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	10,000,350.04	—
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	10,000,350.04	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.7511%	—%

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。

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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	26,441,237.34	33,307.61	16,230,369.03	31,654.12

注: 本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管, 按银行同业利率计息。

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: 本基金本报告期内及上年度可比期间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

于 2026 年 06 月 30 日, 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 429,277,794.66 元, 占本基金资产净值的比例为 44.30% (于 2025 年 12 月 31 日, 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 405,066,613.23 元, 占本基金资产

净值的比例为 43.53%)。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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）	1,035.87	8,880.77
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	80,825.97	1,569.33
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	1,133,235.46	956,733.81
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	224,938.61	202,602.80

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。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的 (ETF 除外)，应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费 (按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2026 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
000032	深桑达 A	2026 年 1 月 29 日	6 个月	非公开发行	15.54	23.64	96,525	1,499,998.50	2,281,851.00	-

				流通受限						
300750	宁德时代	2026年4月24日	6个月	询价转让流通受限	410.34	373.17	3,700	1,518,258.00	1,380,729.00	-
300803	指南针	2026年4月24日	6个月	询价转让流通受限	85.11	85.76	17,600	1,497,936.00	1,509,376.00	-
600819	耀皮玻璃	2026年1月14日	6个月	非公开发发行流通受限	7.17	6.20	209,205	1,499,999.85	1,297,071.00	-
603192	汇得科技	2026年3月5日	6个月	非公开发发行流通受限	22.65	16.45	12,865	291,392.25	211,629.25	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

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因债券正回购交易而作为抵押的交易所市场债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有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。

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发行的证券，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。

6.4.13.2.1 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。

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

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。

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。

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

本基金每份基金份额设有最短持有期。对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，在最短持有期内无法赎回的风险。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货币资金、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 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	26,441,237.34	-	-	-	-	-	26,441,237.34
结算备付金	20,568.79	-	-	-	-	-	20,568.79
存出保证金	5,654.69	-	-	-	-	-	5,654.69
交易性金融资产	10,936,355.18	909,917.26	36,644,587.41	-	-	894,586,197.62	943,077,057.47
应收申购款	166,044.00	-	-	-	-	2,587,690.66	2,753,734.66
应收清算款	-	-	-	-	-	788,318.02	788,318.02
其他资产	-	-	-	-	-	14,647.71	14,647.71
资产总计	37,569,860.00	909,917.26	36,644,587.41	-	-	897,976,854.01	973,101,218.68
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,647,946.28	3,647,946.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	205,408.12	205,408.12
应付托管费	-	-	-	-	-	82,235.15	82,235.15
应交税费	-	-	-	-	-	56,695.73	56,695.73
其他负债	-	-	-	-	-	90,662.08	90,662.08
负债总计	-	-	-	-	-	4,082,947.36	4,082,947.36
利率敏感度缺口	37,569,860.00	909,917.26	36,644,587.41	-	-	893,893,906.65	969,018,271.32
上年度末 2025 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	15,855,838.00	-	-	-	-	-	15,855,838.00

	4						4
结算备付金	4,170.73	-	-	-	-	-	4,170.73
存出保证金	8,816.86	-	-	-	-	-	8,816.86
交易性金融资产	707,808.55	-	47,953,956.19	-	-	861,522,130.68	910,183,895.42
买入返售金融资产	-1,254.79	-	-	-	-	-	-1,254.79
应收申购款	55,716.15	-	-	-	-	2,121,011.23	2,176,727.38
应收清算款	-	-	-	-	-	8,001,566.84	8,001,566.84
其他资产	-	-	-	-	-	5,886.22	5,886.22
资产总计	16,631,095.54	-	47,953,956.19	-	-	871,650,594.97	936,235,646.70
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,134,327.38	5,134,327.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	212,513.63	212,513.63
应付托管费	-	-	-	-	-	85,840.34	85,840.34
应交税费	-	-	-	-	-	12,901.62	12,901.62
其他负债	-	-	-	-	-	177,934.09	177,934.09
负债总计	-	-	-	-	-	5,623,517.06	5,623,517.06
利率敏感度缺口	16,631,095.54	-	47,953,956.19	-	-	866,027,077.91	930,612,129.64

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 1%	325,681.86	230,396.56
	市场利率上升 1%	-320,228.15	-228,137.76

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，为交易而持有的债券公允价值的变动将对净资产产生的影响。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	6,680,656.25	0.69	5,774,626.09	0.62
交易性金融资产—基金投资	887,905,541.37	91.63	855,747,504.59	91.96
交易性金融资产—债券投资	48,490,859.85	5.00	48,661,764.74	5.23
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	943,077,057.47	97.32	910,183,895.42	97.80

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 10%	87,467,277.42	93,636,886.00
	业绩比较基准下降 10%	-87,467,277.42	-93,636,886.00

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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	887,905,541.37	855,747,504.59
第二层次	48,490,859.85	48,661,764.74
第三层次	6,680,656.25	5,774,626.09
合计	943,077,057.47	910,183,895.42

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债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中
--

采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。（2025 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。

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	6,680,656.25	0.69
	其中：股票	6,680,656.25	0.69
2	基金投资	887,905,541.37	91.24
3	固定收益投资	48,490,859.85	4.98
	其中：债券	48,490,859.85	4.98
	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	26,461,806.13	2.72
8	其他各项资产	3,562,355.08	0.37
9	合计	973,101,218.68	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	2,889,429.25	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	2,281,851.00	0.24
F	批发和零售业	—	—
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	1,509,376.00	0.16
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	6,680,656.25	0.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000032	深桑达 A	96,525	2,281,851.00	0.24
2	300803	指南针	17,600	1,509,376.00	0.16
3	300750	宁德时代	3,700	1,380,729.00	0.14
4	600819	耀皮玻璃	209,205	1,297,071.00	0.13
5	603192	汇得科技	12,865	211,629.25	0.02

注：上表中股票名称以报告期末名称为准。

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	300750	宁德时代	1,518,258.00	0.16
2	600819	耀皮玻璃	1,499,999.85	0.16
3	000032	深桑达 A	1,499,998.50	0.16

4	300803	指南针	1,497,936.00	0.16
5	603192	汇得科技	291,392.25	0.03

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	600299	安迪苏	3,229,933.56	0.35
2	688281	华秦科技	1,688,736.82	0.18
3	301011	华立科技	991,286.00	0.11

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	6,307,584.60
卖出股票收入（成交）总额	5,909,956.38

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	18,469,448.89	1.91
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,021,410.96	3.10
	其中：政策性金融债	30,021,410.96	3.10
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	48,490,859.85	5.00

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	260304	26 进出 04	300,000	30,021,410.96	3.10
2	019785	25 国债 13	108,000	10,936,355.18	1.13
3	019835	26 国债 09	48,000	4,807,899.62	0.50
4	019755	24 国债 19	9,000	909,917.26	0.09

5	019792	25 国债 19	9,000	909,443.10	0.09
---	--------	----------	-------	------------	------

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有国债期货，故此项不适用。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

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

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

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	59,914,399.49	72,142,928.43	7.44	是

2	012324	兴全恒惠 30 天持有 超短债 A	契约 型开 放式	60,861,751.81	69,619,757.90	7.18	是
3	001821	兴全天添益 货币 B	契约 型开 放式	40,104,457.47	40,104,457.47	4.14	是
4	002980	华夏创新前 沿股票 A	契约 型开 放式	5,800,000.00	35,252,400.00	3.64	否
5	007360	易方达中短 期美元债债 券 (QDII)A(人 民币份额)	契约 型开 放式	26,128,328.06	30,805,298.78	3.18	否
6	163406	兴全合润混 合 A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	10,000,000.00	29,481,000.00	3.04	是
7	159920	恒生 ETF 华 夏	交易 型开 放式 (ETF)	21,835,800.00	29,412,822.60	3.04	否
8	163415	兴全商业模 式混合 (LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	4,800,000.00	29,116,800.00	3.00	是
9	000082	嘉实研究阿 尔法股票 A	契约 型开 放式	11,000,000.00	28,083,000.00	2.90	否
10	018610	兴全中证同 业存单 AAA 指数 7 天持 有	契约 型开 放式	25,954,247.32	27,386,921.77	2.83	是
11	166009	中欧新动力 混合 (LOF)A	上市 契约	6,500,000.00	25,355,200.00	2.62	否

			型开 放式 (LOF)				
12	166001	中欧新趋势 混合 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	14,200,000.00	23,881,560.00	2.46	否
13	007449	兴全多维价 值混合 A	契约 型开 放式	7,000,000.00	23,758,000.00	2.45	是
14	010624	富国稳健增 长混合 A	契约 型开 放式	24,217,806.40	21,827,508.91	2.25	否
15	016464	兴全合瑞混 合 A	契约 型开 放式	15,051,714.54	21,517,931.11	2.22	是
16	003949	兴全稳泰债 券 A	契约 型开 放式	16,680,056.88	20,594,866.23	2.13	是
17	003293	易方达科瑞 混合	契约 型开 放式	6,500,000.00	18,519,150.00	1.91	否
18	968117	易方达(香 港)精选债 券 M 类(人 民币)	契约 型开 放式	146,666.32	16,824,093.57	1.74	否
19	001975	景顺长城环 保优势股票	契约 型开 放式	3,100,000.00	16,485,800.00	1.70	否
20	015867	国泰海通中 证 1000 指 数增强 A	契约 型开 放式	8,700,000.00	15,563,430.00	1.61	否
21	016481	兴全恒信债 券 A	契约 型开 放式	13,943,606.51	15,396,530.31	1.59	是

22	968155	中银香港亚洲债 C4	契约型开放式	1,792,114.69	14,587,813.58	1.51	否
23	017827	兴全欣越混合 C	契约型开放式	12,448,671.90	13,094,757.97	1.35	是
24	163407	兴全沪深 300 指数增强 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	5,000,000.00	12,985,000.00	1.34	是
25	519915	富国消费主题混合 A	契约型开放式	7,209,080.70	12,702,400.19	1.31	否
26	968052	摩根国际债券人民币累计	契约型开放式	1,146,466.43	12,576,736.74	1.30	否
27	110023	易方达医疗保健行业混合 A	契约型开放式	3,000,000.00	11,856,000.00	1.22	否
28	014339	长江智能制造混合型发起式 A	契约型开放式	8,344,258.55	11,685,299.67	1.21	否
29	159928	消费 ETF 汇添富	交易型开放式 (ETF)	18,816,000.00	11,571,840.00	1.19	否
30	012325	兴全恒惠 30 天持有超短债 C	契约型开放式	8,923,790.83	10,131,179.73	1.05	是
31	968124	高腾亚洲收益基金 M 类 (人民币)- 累积	契约型开放式	1,024,590.16	10,059,733.57	1.04	否
32	020765	兴全中债 0-3 年政策	契约型开	9,593,177.14	9,823,413.39	1.01	是

		性金融债指数 C	放式				
33	020764	兴全中债 0-3 年政策性金融债指数 A	契约型开放式	9,577,216.68	9,808,985.32	1.01	是
34	000577	安信价值精选股票 A	契约型开放式	1,445,842.37	9,096,083.52	0.94	否
35	968114	华夏精选固定收益配置基金 R 类人民币	契约型开放式	7,464,333.11	9,058,714.66	0.93	否
36	007126	博道远航混合 A	契约型开放式	3,971,478.13	8,400,470.54	0.87	否
37	007802	兴全合泰混合 A	契约型开放式	4,064,613.80	7,744,308.67	0.80	是
38	518880	黄金 ETF 华安	交易型开放式 (ETF)	839,500.00	7,033,331.00	0.73	否
39	450009	国富中小盘股票 A	契约型开放式	3,000,000.00	7,006,200.00	0.72	否
40	159915	创业板 ETF 易方达	交易型开放式 (ETF)	1,472,200.00	6,424,680.80	0.66	否
41	011206	创金合信竞争优势混合 A	契约型开放式	9,739,912.40	6,119,586.96	0.63	否
42	562310	沪深 300 成长 ETF 银华	交易型开放式	4,543,600.00	5,574,997.20	0.58	否

			(ETF)				
43	018597	兴全招益债券 A	契约型开放式	4,532,680.63	5,215,302.33	0.54	是
44	519120	浦银新兴产业混合 A	契约型开放式	1,158,355.73	5,203,797.28	0.54	否
45	012948	兴全恒利一年定开债券发起式	契约型开放式	4,662,004.66	5,051,282.05	0.52	是
46	512090	MSCIA 股 ETF 易方达	交易型开放式 (ETF)	1,997,500.00	4,254,675.00	0.44	否
47	270025	广发行业领先混合 A	契约型开放式	2,000,000.00	3,660,000.00	0.38	否
48	506000	科创板基金	上市契约型开放式 (LOF)	2,349,300.00	3,549,792.30	0.37	否
49	006002	工银医药健康股票 A	契约型开放式	1,500,000.00	3,326,550.00	0.34	否
50	340009	兴全磐稳增利债券 A	契约型开放式	2,010,000.00	3,272,280.00	0.34	是
51	515910	质量 ETF 中金	交易型开放式 (ETF)	4,612,900.00	3,256,707.40	0.34	否
52	003380	中信保诚至选混合 C	契约型开放式	2,462,447.67	3,042,846.59	0.31	否

53	163412	兴全轻资产混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	600,000.00	2,934,000.00	0.30	是
54	512170	医疗 ETF 华宝	交易 型开 放式 (ETF)	9,079,500.00	2,778,327.00	0.29	否
55	001667	南方转型增 长灵活配置 混合 A	契约 型开 放式	1,000,000.00	2,720,200.00	0.28	否
56	000628	大成高鑫股 票 A	契约 型开 放式	500,000.00	2,407,200.00	0.25	否
57	022374	富国亚洲收 益债券 (QDII) 人民 币 E	契约 型开 放式	1,945,652.70	2,063,364.69	0.21	否
58	513860	港股通科技 ETF 海富通	交易 型开 放式 (ETF)	3,009,300.00	1,730,347.50	0.18	否
59	506003	富国科创板	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,102,879.00	1,653,215.62	0.17	否
60	506002	易方达科创 板	上市 契约 型开 放式 (LOF)	532,300.00	1,542,605.40	0.16	否
61	510310	沪深 300ETF 易 方达	交易 型开 放式 (ETF)	278,300.00	1,358,104.00	0.14	否

62	506005	科创板博时	上市 契约 型开 放式 (LOF)	620,981.00	1,214,638.84	0.13	否
63	006337	华安安浦债 券 A	契约 型开 放式	1,000,000.00	1,196,400.00	0.12	否
64	161820	银华纯债信 用债券 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,017,344.55	1,178,695.40	0.12	否
65	000471	富国城镇发 展股票	契约 型开 放式	500,000.00	1,147,350.00	0.12	否
66	506001	万家科创板	上市 契约 型开 放式 (LOF)	349,200.00	732,272.40	0.08	否
67	166019	中欧价值智 选混合 A	契约 型开 放式	140,000.00	591,654.00	0.06	否
68	513180	恒生科技 ETF 华夏	交易 型开 放式 (ETF)	1,005,400.00	570,061.80	0.06	否
69	159768	房地产 ETF 银华	交易 型开 放式 (ETF)	1,226,300.00	473,351.80	0.05	否
70	005709	华安鼎益债 券 A	契约 型开 放式	399,507.68	456,517.43	0.05	否
71	506006	汇添富科创 板	上市 契约	269,100.00	438,363.90	0.05	否

			型开 放式 (LOF)				
72	513010	恒生科技 ETF 易方达	交易 型开 放式 (ETF)	738,600.00	431,342.40	0.04	否
73	159741	恒生科技 ETF 嘉实	交易 型开 放式 (ETF)	667,400.00	374,411.40	0.04	否
74	166024	中欧恒利三 年定期开放 混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	199,800.00	208,091.70	0.02	否
74	166024	中欧恒利定 开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	85,100.00	86,631.80	0.01	否
75	162720	创业广发	上市 契约 型开 放式 (LOF)	169,500.00	282,217.50	0.03	否
76	002400	南方亚洲美 元收益债券 (QDII)A(人 民币)	契约 型开 放式	191,840.44	196,674.82	0.02	否
77	159740	恒生科技 ETF 大成	交易 型开 放式 (ETF)	300,700.00	168,392.00	0.02	否
78	161040	创业富国	上市 契约 型开	42,300.00	116,832.60	0.01	否

			放式 (LOF)				
79	169106	东方红创优 定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	101,800.00	112,285.40	0.01	否
80	161914	万家创业	上市 契约 型开 放式 (LOF)	108,800.00	102,380.80	0.01	否
81	022512	南方亚洲美 元收益债券 (QDII)E(人 民币)	契约 型开 放式	96,227.87	98,287.15	0.01	否
82	004417	兴全货币 B	契约 型开 放式	53,891.32	53,891.32	0.01	是
83	001820	兴全天添益 货币 A	契约 型开 放式	44,200.66	44,200.66	0.00	是
84	160926	创业大成	上市 契约 型开 放式 (LOF)	37,200.00	42,370.80	0.00	否
85	160325	华夏创业板 定开	上市 契约 型开 放式 (LOF)	21,000.00	40,278.00	0.00	否
86	160143	创业 LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	15,000.00	31,005.00	0.00	否

87	166027	中欧创业	上市 契约 型开 放式 (LOF)	15,905.00	15,586.90	0.00	否
88	511380	可转债 ETF 博时	交易 型开 放式 (ETF)	700.00	9,767.80	0.00	否

注：对于同时在场内和场外持有的基金，合并计算公允价值参与排序，并按照不同基金分别披露。

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

注：本基金本报告期末未持有公开募集不动产投资信托基金。

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中，嘉实基金管理有限公司、中国进出口银行具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,654.69
2	应收清算款	788,318.02
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	2,753,734.66
6	其他应收款	14,647.71
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,562,355.08

7.13.4 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。

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	000032	深桑达 A	2,281,851.00	0.24	非公开发行流通受限
2	300803	指南针	1,509,376.00	0.16	询价转让流通受限
3	300750	宁德时代	1,380,729.00	0.14	询价转让流通受限
4	600819	耀皮玻璃	1,297,071.00	0.13	非公开发行流通受限
5	603192	汇得科技	211,629.25	0.02	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（%）
兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A	41,370	10,650.47	10,100,992.76	2.29	430,508,940.83	97.71
兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y	10,178	5,410.80	—	—	55,071,100.42	100.00
合计	51,548	9,615.91	10,100,992.76	2.04	485,580,041.25	97.96

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）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	99.81

8.3 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	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A	4,555,759.72	1.0340
	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y	199,292.77	0.3619
	合计	4,755,052.49	0.9593

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）。

8.4 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	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A	>100
	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A	50~100
	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y	0
	合计	50~100

注：本基金的基金经理也是本公司投资部门负责人之一，故上述两点统计数据有重合部分。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）A	兴全安泰平衡养老三年持有混合（FOF）Y
基金合同生效日（2019 年 1 月 25 日）基金份额总额	628,976,962.65	—

本报告期期初基金份额总额	463,763,737.29	46,367,272.59
本报告期基金总申购份额	36,844,849.81	9,901,002.27
减：本报告期基金总赎回份额	59,998,653.51	1,197,174.44
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	440,609,933.59	55,071,100.42

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) 本报告期内，基金管理人重大人事变动：
2026 年 3 月 19 日，基金管理人的财务负责人由陈锦泉先生变更为马亚静女士。
(2) 本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人的相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过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	5,909,956.38	100.00	2,635.14	100.00	—
长江证券	2	—	—	—	—	—
东方证券	1	—	—	—	—	—
东吴证券	2	—	—	—	—	—
广发证券	4	—	—	—	—	—
国海证券	2	—	—	—	—	—
国金证券	2	—	—	—	—	—
国联民生证券	1	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通证券	2	—	—	—	—	—
国投证券	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	—	—	—	—	—
摩根大通证券	2	—	—	—	—	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
招商证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	—
中信建投	3	—	—	—	—	—

证券						
中信证券	5	-	-	-	-	-

注：1. 报告期内无租用证券公司交易单元变更；

2. 上表列示交易单元数量为截至本报告期末本基金租用数量，成交金额及佣金为本报告期间数；

3. 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 基金租用或者通过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	5,696,411.00	100.00	-	-	-	-	30,185,570.30	100.00
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	关于旗下部分基金投资安迪苏（600299）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 1 月 6 日
2	关于旗下部分基金投资耀皮玻璃（600819）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 1 月 16 日
3	关于旗下公募基金产品直销渠道认（申）购费优惠活动的公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 1 月 26 日
4	关于旗下部分基金投资深桑达 A（000032）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 1 月 31 日
5	关于旗下部分基金投资汇得科技（603192）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 3 月 7 日
6	兴证全球基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 3 月 20 日
7	兴证全球基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 3 月 30 日
8	关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、指定互联 网网站	2026 年 6 月 5 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者 类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份 额比例达到 或者超过 20% 的时间区间	期初 份额	申购 份额	赎回 份额	持有份额	份额 占比 (%)
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。本基金非保本产品，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 3 年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 年（3 年指 365 天乘以 3 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，3 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、中国证监会准予基金募集注册的文件；
- 2、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同》；
- 3、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议》；
- 4、关于申请募集基金之法律意见；
- 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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

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、基金托管人住所免费查阅。

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

2026 年 8 月 31 日