

兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 02 月 09 日（基金合同生效日）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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	51

7.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	51
7.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	51
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12	投资组合报告附注	52
§ 8	基金份额持有人信息	54
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	55
§ 9	开放式基金份额变动	55
§ 10	重大事件揭示	56
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	57
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	兴全汇吉一年持有混合	
基金主代码	011336	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 9 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,690,644,996.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全汇吉一年持有混合 A	兴全汇吉一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011336	011337
报告期末下属分级基金的份额总额	3,523,913,294.88 份	166,731,701.83 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，把握债券市场、股票市场的投资机会，通过积极主动的投资管理，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、港股投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×60%
风险收益特征	本基金是混合型基金，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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	胡波
	联系电话	021-20398888	021-61618888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	hub5@spdb.com.cn

客户服务电话	4006780099, 021-38824536	95528
传真	021-20398858	021-63602540
注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-30 楼	上海市北京东路 689 号
邮政编码	201204	200001
法定代表人	杨华辉	郑杨

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-30 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年2月9日(基金合同生效日)-2021年6月30日)	
	兴全汇吉一年持有混合 A	兴全汇吉一年持有混合 C
本期已实现收益	36,623,559.23	1,473,237.42
本期利润	160,811,783.95	7,335,902.09
加权平均基金份额本期利润	0.0457	0.0441
本期加权平均净值利润率	4.60%	4.45%
本期基金份额净值增长率	4.56%	4.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	兴全汇吉一年持有混合 A	兴全汇吉一年持有混合 C
期末可供分配利润	36,626,073.33	1,474,102.63

期末可供分配基金份额利润	0.0104	0.0088
期末基金资产净值	3,684,778,300.98	174,073,826.18
期末基金份额净值	1.0456	1.0440
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.56%	4.40%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第1号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4、本基金合同于2021年2月9日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

兴全汇吉一年持有混合 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
过去一个月	3.11%	0.63%	-0.71%	0.31%	3.82%	0.32%
过去三个月	8.14%	0.53%	1.55%	0.37%	6.59%	0.16%
自基金合同生效起至今	4.56%	0.56%	-1.67%	0.49%	6.23%	0.07%

兴全汇吉一年持有混合 C

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

过去一个月	3.07%	0.63%	-0.71%	0.31%	3.78%	0.32%
过去三个月	8.03%	0.53%	1.55%	0.37%	6.48%	0.16%
自基金合同生效 起至今	4.40%	0.56%	-1.67%	0.49%	6.07%	0.07%

注：1、本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+中债综合（全价）指数收益率×60%。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，适合作为本基金境内股票投资业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券投资业绩的比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 35\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 60\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

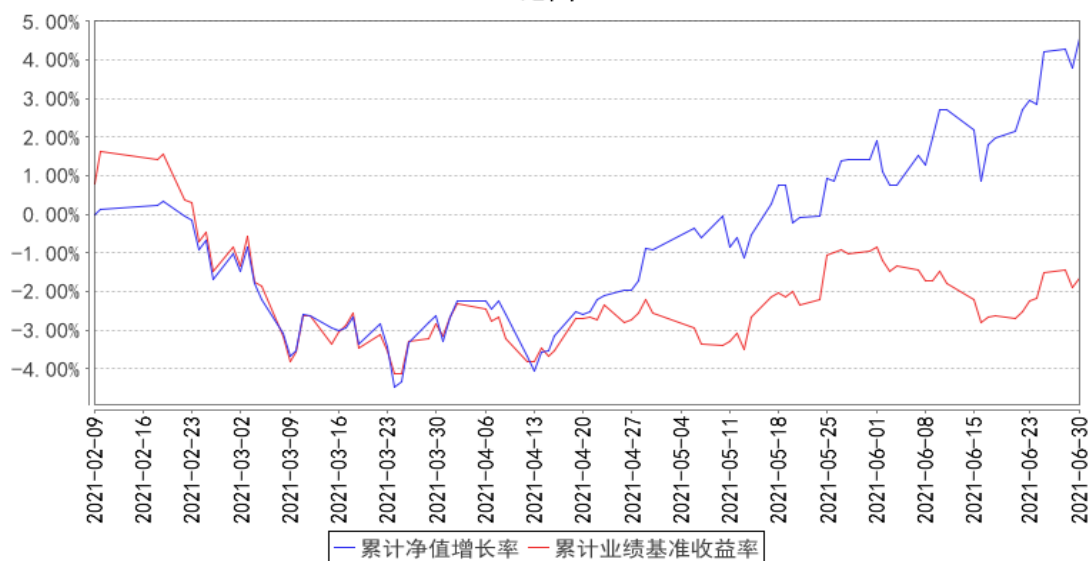
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

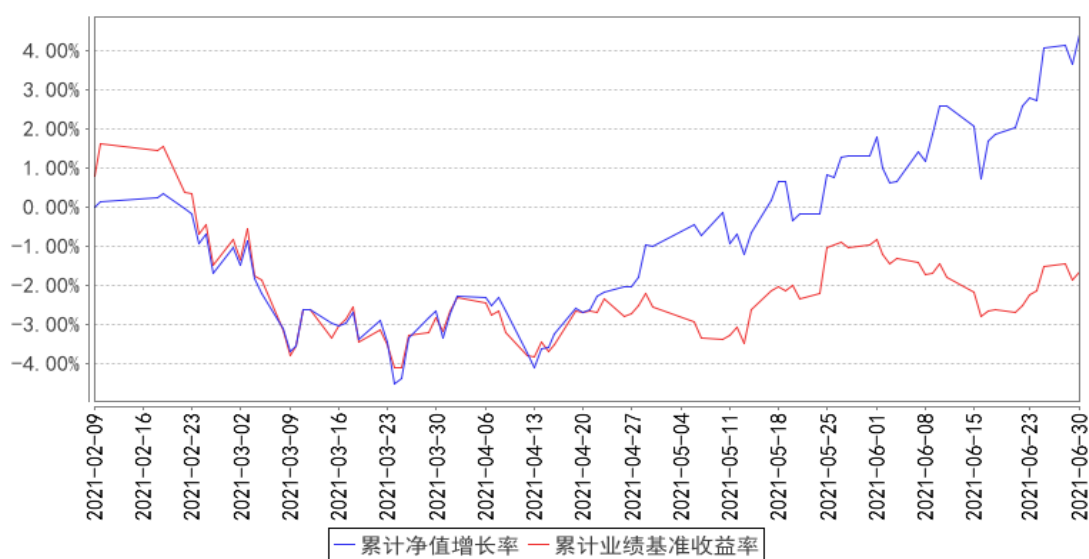
2、本基金成立于 2021 年 2 月 9 日，截至 2021 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

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

兴全汇吉一年持有混合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



兴全汇吉一年持有混合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 2021 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 2 月 9 日至 2021 年 8 月 8 日。截至本报告期末，本基金尚在建仓期内。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例将符合本基金合同规定的比例限制和投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2021 年 2 月 9 日，截至 2021 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至2021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42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		
陈红	固定收益部副总监、投资经理、兴全汇吉一年持有期混合型基金经理、兴全汇虹一年持有期混合型证券投资基金基金经理	2021年2月9日	-	15年	硕士。历任金元比联基金管理公司产品研究岗，平安资产管理有限责任公司投资管理部、固定收益部投资经理，兴证全球基金管理有限公司专户投资部总监助理兼投资经理。
石广翔	兴全稳益定期开放债券型发	2021年2月9日	-	6年	硕士，历任摩根大通中国分析师，平安资产管理有限责任公司高级分析师，兴证全球基金管理有限公司研究部研究员。

起式基金、兴全稳泰债券型基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式基金、兴全祥泰定期开放债券型证券投资基金、兴全汇虹一年持有期混合型证券投资基金、兴全汇吉一年持有期混合型基金基金经理助理				
---	--	--	--	--

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
陈红	公募基金	2	5,147,240,497.15	2021年02月09日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	2	5,147,240,497.15	-

注：1、本报告期末，本基金基金经理兼任私募资产管理计划的投资经理，截至报告期末暂未管理私募资产管理计划；

2、任职日期为该基金经理同时任职基金经理和私募资产管理计划投资经理的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年从经济数据看，一季度经济环比增速较弱，但二季度实际环比增速回升 0.5 个百分点显示中国经济存在较强的韧性。同时经济呈现结构性，消费复苏较平稳，制造业投资改善明显，高新技术产业投资增速相对可观。受益于海外需求恢复，出口维持强劲。PPI 逐月走高，但 CPI 仍维持低位，短期通胀压力不明显。货币政策维持稳健偏宽松。

上半年利率走势整体先升后降。1 月资金面超预期收紧，货币市场利率快速上行，市场担心 PPI 走高以及货币政策转向等因素，债券收益率出现了一定幅度的上行。3 月之后，资金面重回宽松叠加经济数据不及预期，使得市场对于货币政策收紧担忧下降，央行多次重申“保持流动性合理充裕”的政策基调，利率重回下行通道。

权益市场从年初至春节延续了去年以来龙头集中的风格，但 2 月份美债利率快速上行使得市场对于原本基于较低的无风险收益率假设的估值水平进行了重估，股票市场快速调整，抱团风格出现瓦解。进入二季度以后，在宽松的货币背景下，股票市场逐步修复，市场风格更聚焦成长，

如新能源、半导体、医药等板块；同时受益于价格上涨的有色、化工、煤炭等周期性行业也有不错的表现，而传统的地产、家电以及价格持续下跌的农业等板块表现落后。

上半年转债市场一波三折。1 月受信用事件的冲击以及资金利率的上行影响，估值快速压缩，转债市场经历了快速下跌。之后伴随股票市场的风格切换，转债市场情绪逐步修复。5 月份之后在流动性利好的背景下风险偏好显著提升，转债整体估值持续提升，结构性机会不断出现。

本基金自成立以来，权益仓位逐步增加至中枢水平，自下而上精选基本面向好的个股，行业配置方向以景气向上的交运、军工、能源、化工、电子等。同时，组合积极参与新股网下打新，适当参与大宗交易和定增。本基金运作期内积极参与转债市场，自下而上精选个券，结合安全性和弹性，逐步兑现价格较高、临近赎回的转债，关注新上市转债的机会。债券方面，组合维持较低久期，以短久期高等级存单和信用债为主，小幅增加利率债的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全汇吉一年持有混合 A 的基金份额净值为 1.0456 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.56%，同期业绩比较基准收益率为-1.67%；截至本报告期末兴全汇吉一年持有混合 C 的基金份额净值为 1.0440 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.40%，同期业绩比较基准收益率为-1.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入下半年，全球疫情仍在持续演变，外部环境复杂，国内经济增长存在一定压力，且不均衡状态尚未扭转。宏观政策上强调了“跨周期调节”，货币政策维持稳健并保持流动性合理充裕。PPI 仍然维持高位，但向 CPI 传导不顺畅。

在此背景下，债券收益率易下难上，但在绝对收益率水平较低的情况下，下行空间有限，整体上处于低位区间震荡概率较大。

权益市场方面，在流动性宽松背景下，整体市场估值不高，系统性风险较小。市场大概率延续结构性行情，机会仍然集中在业绩增速较快景气度向上的行业、产业升级逻辑明确的行业，以及受益于供需结构改善价格上行周期明显的部分周期性行业。

转债方面，整体估值继续抬升空间不大，转债仍然以结构性机会为主。方向上聚焦于成长，以及正股波动较大的周期性转债，同时关注新券上市的机会。

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、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全汇吉一年持有期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，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由本基金的管理人兴证全球基金管理有限公司编制的、本托管人复核的本报告

中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	77,363,405.45
结算备付金		18,393,426.30
存出保证金		968,358.84
交易性金融资产	6.4.7.2	4,045,187,801.62
其中：股票投资		1,540,015,262.12
基金投资		-
债券投资		2,505,172,539.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		63,837,848.07
应收利息	6.4.7.5	28,173,597.88
应收股利		2,307,642.79
应收申购款		139,981.75
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		4,236,372,062.70
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 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		310,000,000.00
应付证券清算款		62,020,740.55
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,100,939.35
应付托管费		310,093.90
应付销售服务费		55,920.80

应付交易费用	6.4.7.7	1,835,540.74
应交税费		95,682.86
应付利息		26,968.60
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	74,048.74
负债合计		377,519,935.54
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	3,690,644,996.71
未分配利润	6.4.7.10	168,207,130.45
所有者权益合计		3,858,852,127.16
负债和所有者权益总计		4,236,372,062.70

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，兴全汇吉混合 A 基金份额净值 1.0456，基金份额总额 3,523,913,294.88 份；兴全汇吉混合 C 基金份额净值 1.0440，基金份额总额 166,731,701.83 份。

兴全汇吉混合份额总额合计为 3,690,644,996.71 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		190,568,467.94
1. 利息收入		18,551,997.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	964,922.69
债券利息收入		15,312,981.62
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,274,093.19
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		41,965,581.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,154,693.28
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	23,229,031.69
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	9,581,856.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	130,050,889.39

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 18	-
减：二、费用		22,420,781.90
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	14,139,592.53
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	1,413,959.17
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	255,045.95
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	6,231,019.02
5. 利息支出		273,928.80
其中：卖出回购金融资产支出		273,928.80
6. 税金及附加		27,157.84
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	80,078.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		168,147,686.04
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		168,147,686.04

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,685,886,881.84	-	3,685,886,881.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	168,147,686.04	168,147,686.04
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	4,758,114.87	59,444.41	4,817,559.28
其中：1. 基金申购款	4,758,114.87	59,444.41	4,817,559.28
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分	-	-	-

配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,690,644,996.71	168,207,130.45	3,858,852,127.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]108号文准予公开募集注册。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费的不同,将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集基金份额为3,685,886,881.84份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第00072号验资报告。基金合同于2021年2月9日生效。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括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或注册发行的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、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、证券公司短期公司债券、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)。

本基金的业绩基准为:沪深300指数收益率×35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×5%+中债综合(全价)指数收益率×60%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 9 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

(1) 金融资产分类

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

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

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

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 回购协议

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项

负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的可相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

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

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

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率逐日计提；
- (3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40%年费率逐日计提。
- (4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；
- (5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；基金份额持有人因持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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入账。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

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

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、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《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场

场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司抵扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股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。基金通过港股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。

(4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
----	-------------------

活期存款	77,363,405.45
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	77,363,405.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,420,904,475.57	1,540,015,262.12	119,110,786.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,248,935,626.56	1,257,159,739.50
	银行间市场	1,245,296,810.10	1,248,012,800.00
	合计	2,494,232,436.66	2,505,172,539.50
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,915,136,912.23	4,045,187,801.62	130,050,889.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	10,575.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,499.58

应收债券利息	28,156,940.34
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	582.50
合计	28,173,597.88

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,829,920.74
银行间市场应付交易费用	5,620.00
合计	1,835,540.74

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费用	26,135.10
预提信息披露费	47,913.64
合计	74,048.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全汇吉一年持有混合 A

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,519,582,141.55	3,519,582,141.55
本期申购	4,331,153.33	4,331,153.33
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,523,913,294.88	3,523,913,294.88

兴全汇吉一年持有混合 C

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	166,304,740.29	166,304,740.29
本期申购	426,961.54	426,961.54
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	166,731,701.83	166,731,701.83

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全汇吉一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	36,623,559.23	124,188,224.72	160,811,783.95
本期基金份额交易产生的变动数	2,514.10	50,708.05	53,222.15
其中：基金申购款	2,514.10	50,708.05	53,222.15
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	36,626,073.33	124,238,932.77	160,865,006.10

兴全汇吉一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,473,237.42	5,862,664.67	7,335,902.09
本期基金份额交易产生的变动数	865.21	5,357.05	6,222.26
其中：基金申购款	865.21	5,357.05	6,222.26
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	1,474,102.63	5,868,021.72	7,342,124.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
活期存款利息收入		754,176.22
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		203,168.68
其他		7,577.79
合计		964,922.69

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		9,154,693.28
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		9,154,693.28

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		1,956,717,886.77
减：卖出股票成本总额		1,947,563,193.49
买卖股票差价收入		9,154,693.28

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月 30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	23,229,031.69
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	23,229,031.69

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6 月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,813,137,921.33
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,783,558,047.09
减：应收利息总额	6,350,842.55
买卖债券差价收入	23,229,031.69

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,581,856.08
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	9,581,856.08

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	130,050,889.39
股票投资	119,110,786.55
债券投资	10,940,102.84
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	130,050,889.39

6.4.7.18 其他收入

注：无。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	6,222,024.02
银行间市场交易费用	8,995.00
合计	6,231,019.02

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	26,135.10
信息披露费	47,913.64
证券出借违约金	-
银行费用	6,029.85
合计	80,078.59

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球”	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构

基金”)	
上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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
	2021年2月9日(基金合同生效日)至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,139,592.53
其中：支付销售机构的客户维护费	6,226,896.86

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1%的年费率计提。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%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,413,959.17

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。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×0.1%/当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2021 年 2 月 9 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全汇吉一年持有混合 A	兴全汇吉一年持有混合 C	合计
兴证全球基金		5,871.19	5,871.19
浦发银行		206,329.50	206,329.50
兴业证券		905.30	905.30
合计		213,105.99	213,105.99

注：兴全汇吉一年持有混合 C 基金销售服务费=兴全汇吉一年持有混合 C 前一日基金资产净值×0.40%/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：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内没有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。

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：本基金本报告期内没有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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金。

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于本报告期末未持有本基金。

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 2021年2月9日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	77,363,405.45	754,176.22

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注	
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-	
300962	中金辐照	2021年3月	2021年10月	新股流通	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	

		月 29 日	月 11 日	受限						
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣 股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股 流通 受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰 生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股 流通 受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股 流通 受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益 通	2021 年 5	2021 年 11	新股 流通	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

		月 12 日	月 22 日	受限						
300992	泰福 泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马 遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股 流通 受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联 软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股 流通 受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐 家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛 股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益 股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股 流通 受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股 流通 受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立 科技	2021 年 6	2021 年 12	新股 流通	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

		月 9 日	月 17 日	受限						
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔 伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉 平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股 流通 受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301017	漱玉 平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股 流通 受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301020	密封 科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封 科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605287	德才 股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科 再生	2021 年 6	2021 年 7	新股 流通	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

		月 30 日	月 9 日	受限						
688099	晶晨 股份	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 3 日	大宗 交易 购入 流通 受限	79.53	106.01	300,000	23,859,000.00	31,803,000.00	-
688169	石头 科技	2021 年 4 月 23 日	2021 年 10 月 25 日	大宗 交易 购入 流通 受限	1,058.00	1,154.68	20,000	21,160,000.00	23,093,600.00	-
688226	威腾 电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688276	百克 生物	2021 年 6 月 17 日	2021 年 12 月 27 日	新股 流通 受限	36.35	79.48	3,486	126,716.10	277,067.28	-
688345	博力 威	2021 年 6 月 3 日	2021 年 12 月 13 日	新股 流通 受限	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
113050	南银 转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	新发 未上 市	100.00	100.00	85,040	8,504,000.00	8,504,000.00	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有因参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和合规管理部以及审计部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日
A-1	120,701,000.00
A-1 以下	-
未评级	160,382,000.00
合计	281,083,000.00

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未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	630,114,147.20
AAA 以下	750,509,524.10
未评级	-
合计	1,380,623,671.30

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	614,705,000.00
合计	614,705,000.00

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，除在本报告附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，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票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	77,363,405.45	-	-	-	-	-	77,363,405.45
结算备付金	18,393,426.30	-	-	-	-	-	18,393,426.30
存出保证金	968,358.84	-	-	-	-	-	968,358.84

	4						
交易性金融资产	115,339,340.00	314,315,200.00	1,224,501,418.20	519,004,839.10	332,011,742.20	1,540,015,262.12	4,045,187,801.62
应收利息	-	-	-	-	-	28,173,597.88	28,173,597.88
应收股利	-	-	-	-	-	2,307,642.79	2,307,642.79
应收申购款	3,059.63	-	-	-	-	-136,922.12	139,981.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	63,837,848.07	63,837,848.07
资产总计	212,067,590.22	314,315,200.00	1,224,501,418.20	519,004,839.10	332,011,742.20	1,634,471,272.98	4,236,372,062.70
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,100,939.35	3,100,939.35
应付托管费	-	-	-	-	-	-310,093.90	310,093.90
应付证券清算款	-	-	-	-	-	62,020,740.55	62,020,740.55
卖出回购金融资产款	310,000,000.00	-	-	-	-	-	310,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	55,920.80	55,920.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,835,540.74	1,835,540.74
应付利息	-	-	-	-	-	26,968.60	26,968.60
应交税费	-	-	-	-	-	95,682.86	95,682.86
其他负债	-	-	-	-	-	74,048.74	74,048.74
负债总计	310,000,000.00	-	-	-	-	67,519,935.54	377,519,935.54
利率敏感度缺口	-97,932,409.78	314,315,200.00	1,224,501,418.20	519,004,839.10	332,011,742.20	1,566,951,337.44	3,858,852,127.16

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)。	
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(2021年6月30日)	

分析	1. 市场利率下降 1%	18,140,876.85
	2. 市场利率上升 1%	-16,119,867.90

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基金净值产生的影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	221,979,914.33	-	221,979,914.33
资产合计	-	221,979,914.33	-	221,979,914.33
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	-	221,979,914.33	-	221,979,914.33

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变	
	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（2021 年 6 月 30 日）
分析	所有外币对人民币升值 5%	11,098,995.72

	所有外币对人民币贬值 5%	-11,098,995.72
--	---------------	----------------

6.4.13.4.3 其他价格风险

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 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,540,015,262.12	39.91
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,505,172,539.50	64.92
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	4,045,187,801.62	104.83

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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；	
	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（2021年6月30日）
	业绩比较基准上升 10%	505,243,491.25

	业绩比较基准下降 10%	-505,243,491.25
--	-----------------	-----------------

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,540,015,262.12	36.35
	其中：股票	1,540,015,262.12	36.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,505,172,539.50	59.13
	其中：债券	2,505,172,539.50	59.13
	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	95,756,831.75	2.26
8	其他各项资产	95,427,429.33	2.25
9	合计	4,236,372,062.70	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 221,979,914.33 元，占净值比例 5.75%。

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	3,801,046.28	0.10
B	采矿业	57,667,878.30	1.49

C	制造业	697,674,772.14	18.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	45,361,166.22	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	241,147,810.20	6.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,825,407.83	0.82
J	金融业	102,173,757.38	2.65
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	111,029,497.50	2.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,285.02	0.00
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	27,325,050.48	0.71
	合计	1,318,035,347.79	34.16

7.2.2 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	42,176,471.04	1.09
非日常生活消费品	24,937,437.60	0.65
日常消费品	-	-
能源	125,395,795.65	3.25
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	29,470,210.04	0.76
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	221,979,914.33	5.75

注：以上分类采用全球行业分类标准（Global Industry Classification Standard, GICS）。

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	601919	中远海控	7,896,130	241,147,810.20	6.25
2	002049	紫光国微	824,302	127,099,125.38	3.29

3	00883	中国海洋石油	17,067,000	125,395,795.65	3.25
4	601888	中国中免	369,975	111,029,497.50	2.88
5	601009	南京银行	6,339,289	66,689,320.28	1.73
6	000963	华东医药	984,300	45,287,643.00	1.17
7	06865	福莱特玻璃	1,584,000	42,176,471.04	1.09
8	300760	迈瑞医疗	86,671	41,606,413.55	1.08
9	300408	三环集团	976,600	41,427,372.00	1.07
10	688169	石头科技	34,171	40,963,231.00	1.06
11	000100	TCL 科技	5,257,900	40,222,935.00	1.04
12	600399	抚顺特钢	2,077,100	37,678,594.00	0.98
13	002179	中航光电	451,310	35,662,516.20	0.92
14	600030	中信证券	1,421,400	35,449,716.00	0.92
15	300750	宁德时代	63,600	34,013,280.00	0.88
16	000949	新乡化纤	3,885,460	32,909,846.20	0.85
17	000933	神火股份	3,425,300	32,369,085.00	0.84
18	688099	晶晨股份	300,000	31,803,000.00	0.82
19	601699	潞安环能	2,631,030	31,072,464.30	0.81
20	00799	IGG	3,452,000	29,470,210.04	0.76
21	300474	景嘉微	291,900	28,582,848.00	0.74
22	600141	兴发集团	1,453,480	27,369,028.40	0.71
23	000009	中国宝安	1,495,624	27,325,050.48	0.71
24	002050	三花智控	1,139,329	27,321,109.42	0.71
25	601636	旗滨集团	1,467,200	27,231,232.00	0.71
26	600596	新安股份	1,534,349	27,188,664.28	0.70
27	300587	天铁股份	1,190,200	26,719,990.00	0.69
28	600123	兰花科创	3,436,100	26,595,414.00	0.69
29	03998	波司登	5,400,000	24,937,437.60	0.65
30	002938	鹏鼎控股	590,200	21,176,376.00	0.55
31	000683	远兴能源	4,424,800	20,663,816.00	0.54
32	600862	中航高科	485,771	14,952,031.38	0.39
33	600063	皖维高新	2,229,600	11,415,552.00	0.30
34	002299	圣农发展	158,700	3,789,756.00	0.10
35	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
36	688276	百克生物	3,486	277,067.28	0.01
37	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.00
38	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
39	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
40	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
41	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
42	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
43	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
44	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00

45	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
46	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
47	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
48	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
49	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
50	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
51	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
52	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
53	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
54	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
55	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
56	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
57	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
58	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
59	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
60	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
61	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
62	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
63	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
64	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
65	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
66	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
67	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
68	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
69	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
70	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
71	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
72	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
73	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
74	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
75	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601919	中远海控	138,600,048.89	3.59
2	00883 HS	中国海洋石油	137,403,897.70	3.56
3	000933	神火股份	134,611,722.25	3.49
4	601888	中国中免	113,611,566.40	2.94

5	002049	紫光国微	111,497,249.88	2.89
6	601899	紫金矿业	101,310,200.29	2.63
7	600460	士兰微	94,351,450.24	2.45
8	000858	五粮液	85,042,297.17	2.20
9	601318	中国平安	74,875,259.73	1.94
10	601636	旗滨集团	73,991,954.51	1.92
11	300059	东方财富	69,898,879.32	1.81
12	000830	鲁西化工	68,452,190.02	1.77
13	000100	TCL 科技	66,155,455.00	1.71
14	601009	南京银行	65,532,854.84	1.70
15	600801	华新水泥	65,267,688.70	1.69
16	600299	安迪苏	61,676,901.39	1.60
17	600519	贵州茅台	61,073,854.25	1.58
18	601088	中国神华	58,804,753.84	1.52
19	002001	新和成	53,399,364.51	1.38
20	603267	鸿远电子	52,525,881.33	1.36

7.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600460	士兰微	151,738,024.77	3.93
2	601899	紫金矿业	114,139,410.68	2.96
3	000933	神火股份	107,814,418.06	2.79
4	000858	五粮液	79,211,269.34	2.05
5	000830	鲁西化工	74,719,978.09	1.94
6	601318	中国平安	69,476,761.87	1.80
7	600801	华新水泥	65,948,227.08	1.71
8	300059	东方财富	65,098,763.73	1.69
9	600519	贵州茅台	60,781,177.18	1.58
10	601088	中国神华	59,507,435.33	1.54
11	601636	旗滨集团	57,496,693.29	1.49
12	00688 HS	中国海外发展	53,782,767.79	1.39
13	603267	鸿远电子	51,891,510.26	1.34
14	600299	安迪苏	49,927,321.74	1.29
15	002001	新和成	49,534,418.80	1.28
16	601233	桐昆股份	45,870,292.69	1.19
17	03323 HS	中国建材	39,917,344.68	1.03
18	000338	潍柴动力	38,129,498.98	0.99
19	601166	兴业银行	37,269,817.87	0.97
20	601601	中国太保	35,537,264.60	0.92

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	3,368,467,669.06
卖出股票收入（成交）总额	1,956,717,886.77

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	228,760,868.20	5.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	317,617,000.00	8.23
5	企业短期融资券	281,083,000.00	7.28
6	中期票据	321,735,800.00	8.34
7	可转债（可交换债）	741,270,871.30	19.21
8	同业存单	614,705,000.00	15.93
9	其他	-	-
10	合计	2,505,172,539.50	64.92

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	019649	21 国债 01	1,240,260	124,112,818.20	3.22
2	112193653	21 成都银行 CD031	1,000,000	98,790,000.00	2.56
3	112105026	21 建设银行 CD026	1,000,000	97,340,000.00	2.52
4	112105028	21 建设银行 CD028	1,000,000	97,330,000.00	2.52
4	112106045	21 交通银行 CD045	1,000,000	97,330,000.00	2.52
5	112103017	21 农业银行 CD017	1,000,000	97,320,000.00	2.52

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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

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。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 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 投资组合报告附注

7.12.1 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中，成都银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；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受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 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	968,358.84
2	应收证券清算款	63,837,848.07
3	应收股利	2,307,642.79

4	应收利息	28,173,597.88
5	应收申购款	139,981.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	95,427,429.33

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110053	苏银转债	69,927,632.00	1.81
2	127020	中金转债	51,211,580.10	1.33
3	110067	华安转债	40,108,479.60	1.04
4	127005	长证转债	36,566,188.12	0.95
5	113545	金能转债	36,016,240.70	0.93
6	127027	靖远转债	35,239,990.36	0.91
7	127023	华菱转 2	34,167,340.00	0.89
8	128046	利尔转债	29,862,512.76	0.77
9	123085	万顺转 2	29,259,695.42	0.76
10	113611	福 20 转债	29,188,184.90	0.76
11	132014	18 中化 EB	26,525,447.40	0.69
12	127018	本钢转债	24,469,660.08	0.63
13	113034	滨化转债	22,900,378.20	0.59
14	128081	海亮转债	22,895,508.50	0.59
15	128073	哈尔转债	18,341,715.00	0.48
16	128111	中矿转债	18,133,488.60	0.47
17	123070	鹏辉转债	18,000,997.73	0.47
18	113014	林洋转债	17,359,176.00	0.45
19	127026	超声转债	14,282,033.15	0.37
20	113525	台华转债	14,155,540.80	0.37
21	123078	飞凯转债	12,060,438.37	0.31
22	128105	长集转债	11,405,060.14	0.30
23	110074	精达转债	10,825,861.40	0.28
24	113537	文灿转债	10,323,280.70	0.27
25	113599	嘉友转债	9,327,231.90	0.24
26	113549	白电转债	8,347,141.60	0.22
27	113550	常汽转债	7,739,330.70	0.20
28	110043	无锡转债	5,274,550.80	0.14
29	113548	石英转债	4,343,149.80	0.11
30	128113	比音转债	3,873,357.60	0.10
31	128130	景兴转债	3,358,999.18	0.09

7.12.5 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	688169	石头科技	23,093,600.00	0.60	大宗交易购入 流通受限

7.12.6 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。

§ 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 (%)
兴全汇吉一年持有混合 A	26,090	135,067.59	2,970,927.03	0.08	3,520,942,367.85	99.92
兴全汇吉一年持有混合 C	8,604	19,378.39	-	-	166,731,701.83	100.00
合计	34,694	106,377.04	2,970,927.03	0.08	3,687,674,069.68	99.92

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全汇吉一年持有混合 A	382,401.03	0.0109
	兴全汇吉一年持有混合 C	100.02	0.0001
	合计	382,501.05	0.0104

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	兴全汇吉一年持有混合 A	0
	兴全汇吉一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全汇吉一年持有混合 A	0~10
	兴全汇吉一年持有混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全汇吉一年持有混合 A	兴全汇吉一年持有混合 C
基金合同生效日（2021 年 2 月 9 日）基金份额总额	3,519,582,141.55	166,304,740.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,331,153.33	426,961.54
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-

本报告期末基金份额总额	3,523,913,294.88	166,731,701.83
-------------	------------------	----------------

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
华泰证券	2	5,259,614,816.67	100.00%	3,351,899.36	100.00%	-

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

10.7.2 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
华泰证券	4,565,865,228.20	100.00%	18,220,800,000.00	100.00%	-	-

10.8 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	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金合同	证券时报及规定互联网网站	2021-01-19
2	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金托管协议	证券时报及规定互联网网站	2021-01-19
3	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金招募说明书	证券时报及规定互联网网站	2021-01-19
4	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金份额发售公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-19
5	关于开展兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金网上直销认购费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-27
6	关于增加兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-01
7	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-10
8	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-05
9	兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金开放日常申购（含转换转入、定期定额投资）业务公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-29
10	关于兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金参加部分销售机构申购、定投、转换转入费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-30
11	关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-17
12	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-16
13	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-17
14	关于调整网上直销基金转换、赎回申购、汇款交易优惠费率的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-18

§ 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

本基金每份基金份额最短持有期为 1 年。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册兴全汇吉一年持有期混合型证券投资基金的法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基

金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

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

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日