兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）
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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 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 8
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 13
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 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50
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 52

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 52
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 52
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 本报告期投资基金情况 52
7.13 投资组合报告附注 ..... **错误!未定义书签。**

§8 基金份额持有人信息 62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 63
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 63

§9 开放式基金份额变动 63

§10 重大事件揭示 63

10.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 64
10.4 基金投资策略的改变 64
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 64
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 64
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 64
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 64
10.9 其他重大事件 65

§11 影响投资者决策的其他重要信息 66

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 66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 66

§12 备查文件目录 67

12.1 备查文件目录 67
12.2 存放地点 67
12.3 查阅方式 67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	兴全优选进取三个月持有混合 FOF
基金主代码	008145
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,454,043,545.66 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略包括：大类资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%
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。

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。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 个月（3 个月指 30 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 个月内无法赎回的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099，021-38824536	95588
传真		021-20398858	010-66105798

注册地址	上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	201204	100140
法定代表人	杨华辉	陈四清

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 号浦东嘉里城办公楼 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 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	275,903,694.79
本期利润	225,872,790.20
加权平均基金份额本期利润	0.0808
本期加权平均净值利润率	5.70%
本期基金份额净值增长率	5.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	474,261,069.01
期末可供分配基金份额利润	0.1933
期末基金资产净值	3,574,107,727.54
期末基金份额净值	1.4564
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	45.64%

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。

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

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	0.79%	0.58%	1.75%	0.78%	-0.96%	-0.20%
过去三个月	5.44%	0.60%	10.23%	0.83%	-4.79%	-0.23%
过去六个月	5.77%	0.85%	6.95%	1.14%	-1.18%	-0.29%
过去一年	31.08%	0.91%	28.65%	1.12%	2.43%	-0.21%
自基金合同生效起至今	45.64%	0.91%	38.49%	1.12%	7.15%	-0.21%

注：1、本基金业绩比较基准：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合（全价）指数收益率×20%

采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：本基金不低于 80%的资产投资于公开募集的证券投资基金，中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。

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。

选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩，反映本基金的风格特点。

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：

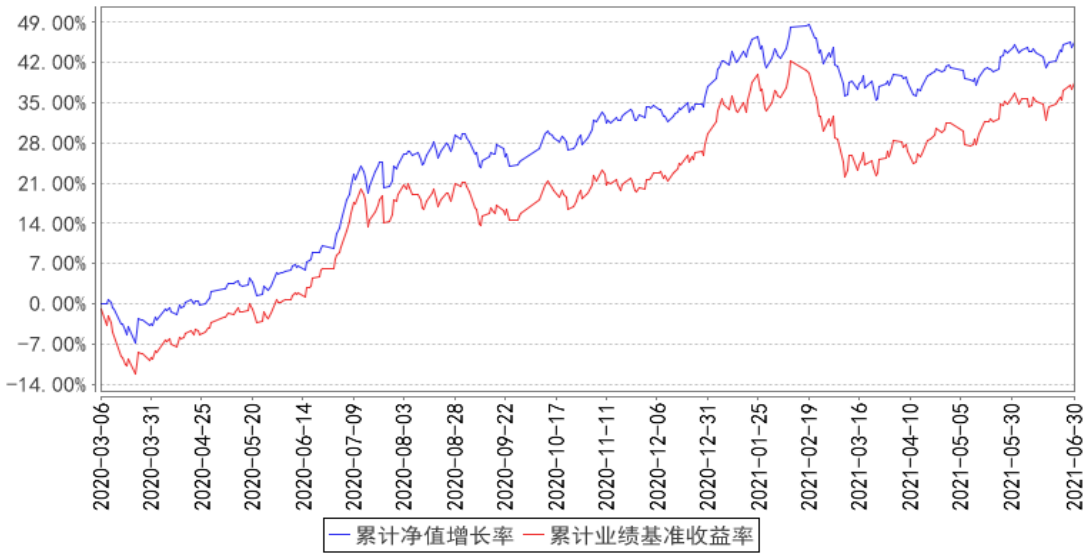
Return t=（中证偏股型基金指数收益率 t/中证偏股型基金指数收益率 t-1 -1）*80%+（中债综合（全价）指数收益率 t/中债综合（全价）指数收益率 t-1 -1）*20%

Benchmark t=（1+Return t）*（1+Benchmark t-1）-1

其中，t=1，2，3.....T，T 表示时间截止日。

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

兴全优选进取三个月持有混合FOF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《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2020 年 3 月 6 日至 2020 年 9 月 5 日。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。

3.3 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		
林国怀	FOF 投资与金融工程部、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中	2020 年 3 月 6 日	-	14 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。

	基金（FOF）基金经理				
丁凯琳	本基金的基金经理	2020 年 12 月 9 日	-	8 年	硕士。历任美国 Spot Trading 研究员，美国芝加哥商品交易所量化分析师，兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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。

4.2 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、《兴全优选进取三个月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、考察是否存在非公平的因素。

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

2021 年上半年股票市场大幅震荡，年初在“茅指数”的带动下市场快速上涨，同时分化明显；

春节后市场开始出现较大幅度的回调，前期涨幅较大的板块和个股跌幅领先，但经过 3、4 月份的市场震荡后，市场重拾升势，在新能源、半导体以及部分周期股的带动下又快速上涨。上半年，以创业板 50 为代表的成长板块涨幅居前，创业板 50 指数上涨 23.11%，创业板指上涨 17.22%；以高股息周期股为主的中证红利指数上半年上涨 12.14%；中小盘风格的中证 500 和中证 1000 分别上涨 6.93%和 6.58%；而主流的沪深 300、上证 50 指数分别上涨 0.24%和下跌 3.9%。从市场风格上来看，上半年高市盈率指数和高市净率指数整体表现更为出色，价值因子再度落后；小盘风格指数优于中盘风格和大盘风格。从基金市场表现来看，偏股基金指数上半年上涨 8.32%，中长期纯债基金指数上涨 1.85%，黄金 ETF 下跌 6.91%。

资产配置层面，本基金坚持 80%的权益类资产和 20%的固定收益类资产的战略资产配置。但在战术资产配置层面，春节之前随着股票市场的快速上涨，不少行业和个股的估值水平已经处于历史极高位置，所以组合在上涨的过程中逐步下降权益资产的配置比例，增加固定收益类资产的配置比例，同时维持一定比例的港股基金和黄金 ETF 在组合中的占比。

基金选择层面，本基金在春节前不断降低以“核心资产”为主要配置标的的基金占比，春节后随着市场的下跌，逐步增加性价比相对更优的基金在组合中的占比；固定收益基金方面，小幅增加了部分规模适中的偏债混合型基金进行增厚收益；同时，积极参与市场上有绝对收益和相对收益的投资机会，不断地优化组合。

上半年整体组合跑输业绩比较基准，主要是在成长风格上暴露不足，而在价值风格上整体暴露较多。在我们的投资理念里，再好的资产也应该有一个相对合理的价格，所以我们在进行基金投资的过程中，一方面我们注重成长性，另一方面我们也非常在意安全边际，但正如前文所述，上半年高市盈率和高市净率指数表现相对更优，理念的偏差导致上半年净值表现不尽如人意，但在组合的波动率、最大回撤方面整体控制还相对良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4564 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.77%，业绩比较基准收益率为 6.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着央行的超预期降准，市场对于宏观经济的判断开始出现分歧，越来越多的投资者开始担忧后续的宏观经济，目前从宏观经济数据来看，也有边际放缓的趋势；整体市场的估值水平相对中性，但分化依然尤为明显，部分行业和板块的估值水平处于历史极高水平，同时也有部分行业和板块的估值水平处于历史极低水平。从基金的二季报的情况来看，食品饮料、医药、电子和新能源四个板块在权益基金的持仓中占据较大的权重，整体基金市场出现了较高的行业偏离现象。

我们仍然对 A 股的长期走势保持乐观，但从中短期而言，因为市场预期过于一致，机构投资者的持仓整体估值水平偏高，我们对此保持谨慎，所以在整体的组合管理过程中，我们会做好板块之间的再平衡，始终把组合的安全边际作为重要考量，积极把握市场上确定性较高的投资机会。

本基金是一只进取风格的普通 FOF 产品，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，为持有人争取更高的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、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》、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的托管

过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，本基金管理人——兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对兴证全球基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	56,199,087.93	104,872,965.90
结算备付金		246,512.11	688,047.43
存出保证金		121,650.04	164,281.15
交易性金融资产	6.4.7.2	3,525,669,691.72	4,293,990,631.15
其中：股票投资		229,980,336.78	259,116,831.72
基金投资		3,050,092,924.90	3,745,788,856.73
债券投资		245,596,430.04	289,084,942.70
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		18,859,505.88	48,876,290.80
应收利息	6.4.7.5	3,259,391.72	2,218,884.88
应收股利		-	1,291,189.10
应收申购款		5,064,092.59	21,508,507.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		3,609,419,931.99	4,473,610,798.31
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**	**上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		31,675,002.95	45,547,748.78
应付管理人报酬		2,264,246.24	2,604,000.03
应付托管费		515,283.00	609,232.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	64,196.81	204,294.24
应交税费		608,943.29	200,247.96
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	184,532.16	288,079.41
负债合计		35,312,204.45	49,453,602.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,454,043,545.66	3,212,939,287.60
未分配利润	6.4.7.10	1,120,064,181.88	1,211,217,908.24
所有者权益合计		3,574,107,727.54	4,424,157,195.84
负债和所有者权益总计		3,609,419,931.99	4,473,610,798.31

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4564 元，基金份额总额 2,454,043,545.66 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		246,645,524.14	256,045,395.55
1.利息收入		2,878,524.27	663,340.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	153,573.82	559,594.73
债券利息收入		2,724,950.45	14,148.01

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	89,597.40
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		289,806,215.56	35,451,507.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	34,901,519.52	4,257,605.30
基金投资收益	6.4.7.13	213,394,826.86	11,922,722.88
债券投资收益	6.4.7.14	2,424,989.37	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	39,084,879.81	19,271,179.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-50,030,904.59	219,190,609.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	3,991,688.90	739,938.15
减：二、费用		20,772,733.94	6,795,868.20
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	14,717,616.77	4,838,877.05
2．托管费	6.4.10.2.2	3,330,766.97	1,212,105.22
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.20	2,397,978.81	659,991.46
5．利息支出		12,852.18	-
其中：卖出回购金融资产支出		12,852.18	-
6．税金及附加		197,449.41	14,530.94
7．其他费用	6.4.7.21	116,069.80	70,363.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		225,872,790.20	249,249,527.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		225,872,790.20	249,249,527.35

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	3,212,939,287.60	1,211,217,908.24	4,424,157,195.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	225,872,790.20	225,872,790.20
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）	-758,895,741.94	-317,026,516.56	-1,075,922,258.50
其中：1.基金申购款	749,120,325.93	314,950,125.91	1,064,070,451.84
2.基金赎回款	-1,508,016,067.87	-631,976,642.47	-2,139,992,710.34
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）	2,454,043,545.66	1,120,064,181.88	3,574,107,727.54
项目	上年度可比期间 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 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）	1,978,308,637.71	-	1,978,308,637.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	249,249,527.35	249,249,527.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	218,453,496.16	-5,128,606.33	213,324,889.83

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	495,858,808.26	13,442,094.72	509,300,902.98
2.基金赎回款	-277,405,312.10	-18,570,701.05	-295,976,013.15
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）	2,196,762,133.87	244,120,921.02	2,440,883,054.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉	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

兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2019]1862 号文准予募集注册，由兴证全球基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 1,978,308,637.71 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为中国工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 基金和香港互认基金）、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）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、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%，其中，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 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%。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：中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合(全价)指数收益率×20%。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况、自 2021 年 1 月 1 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 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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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[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]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]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；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，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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。

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，对受让方不再缴纳印花税。

5) 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	56,199,087.93
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	56,199,087.93

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		205,842,841.46	229,980,336.78	24,137,495.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	125,965,634.13	124,416,430.04	-1,549,204.09
	银行间市场	121,197,900.00	121,180,000.00	-17,900.00
	合计	247,163,534.13	245,596,430.04	-1,567,104.09
资产支持证券		-	-	-
基金		2,434,705,879.84	3,050,092,924.90	615,387,045.06
其他		-	-	-
合计		2,887,712,255.43	3,525,669,691.72	637,957,436.29

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	6,692.28
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	99.81
应收债券利息	3,252,550.31
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	49.32
合计	3,259,391.72

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	63,646.81
银行间市场应付交易费用	550.00
合计	64,196.81

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	97,751.71
应付证券出借违约金	-
预提费用	86,780.45
合计	184,532.16

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,212,939,287.60	3,212,939,287.60
本期申购	749,120,325.93	749,120,325.93
本期赎回（以“-”号填列）	-1,508,016,067.87	-1,508,016,067.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,454,043,545.66	2,454,043,545.66

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	313,096,685.14	898,121,223.10	1,211,217,908.24
本期利润	275,903,694.79	-50,030,904.59	225,872,790.20
本期基金份额交易产生的变动数	-114,739,310.92	-202,287,205.64	-317,026,516.56
其中：基金申购款	109,615,604.09	205,334,521.82	314,950,125.91
基金赎回款	-224,354,915.01	-407,621,727.46	-631,976,642.47

本期已分配利润	-	-	-
本期末	474,261,069.01	645,803,112.87	1,120,064,181.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	142,150.09
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	3,896.94
其他	7,526.79
合计	153,573.82

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1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	34,901,519.52
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	34,901,519.52

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	148,434,312.27
减：卖出股票成本总额	113,532,792.75
买卖股票差价收入	34,901,519.52

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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	1,379,629,374.82
减：卖出/赎回基金成本总额	1,166,234,547.96
基金投资收益	213,394,826.86

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1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	2,424,989.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,424,989.37

6.4.7.14.2 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1月1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	152,723,132.87
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	148,855,849.38
减：应收利息总额	1,442,294.12
买卖债券差价收入	2,424,989.37

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.14.5 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。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,439,037.29
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	37,645,842.52
合计	39,084,879.81

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-50,030,904.59

股票投资	-8,991,984.07
债券投资	-1,548,063.28
资产支持证券投资	-
基金投资	-39,490,857.24
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	-50,030,904.59

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,991,688.90
合计	3,991,688.90

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	319,762.39
银行间市场交易费用	550.00
交易基金产生的费用	2,077,666.42
其中：申购费	11,000.00
赎回费	1,823,961.77
交易费	18,287.05
转换费	224,417.60
合计	2,397,978.81

6.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	81,744.60
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	19,376,673.45
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,331,092.08

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。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费用	9,000.00
银行费用	20,289.35
合计	116,069.80

6.4.7.22 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

自 2021 年 08 月 10 日起 ，增设兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金(FOF) C 类基金份额

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司(“兴证全球基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020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	66,667,376.86	42.13	163,071,101.61	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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020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	5,321,440.07	24.96	21,908,881.03	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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020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	-	-	600,000,000.00	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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020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	71,580,866.56	12.44	1,083,870,194.63	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间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 2021年1月1日至2021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	42,323.25	32.76	13,084.70	20.56
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020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	113,852.05	100.00	48,922.54	100.00

注：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。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,717,616.77	4,838,877.05
其中：支付销售机构的客户维护费	7,463,790.24	2,870,707.41

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%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。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扣除本基金投资于本管理人所管理的基金的部分×1.00%/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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,330,766.97	1,212,105.22

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%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。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

净值扣除本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分×0.20%/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：本基金本报告期内无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。

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：本基金本报告期内无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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020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
工商银行	56,199,087.93	142,150.09	157,883,992.69	543,893.45

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期未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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计883,287,970.31 元，占本基金资产净值的比例为 24.71%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 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）	494,249.54	79,595.86
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	6,374,538.12	2,508,926.22
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,104,238.82	434,152.03
-	-	-

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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期未进行利润分配。

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
000723	美锦能源	2021 年 1 月 28 日	2021 年 08 月 04 日	非公开发行流通受限	5.60	7.33	1,428,572	8,000,003.20	10,471,432.76	-
002139	拓邦	2021	2021	非公	11.40	16.38	526,316	6,000,002.40	8,621,056.08	-

	股份	年 6 月 1 日	年 12 月 3 日	开发行流通受限						
002414	高德红外	2021 年 4 月 26 日	2021 年 10 月 28 日	非公开发行流通受限	29.67	26.01	168,670	5,004,438.90	4,387,106.70	-
002414	高德红外	2021 年 6 月 1 日	2021 年 10 月 28 日	非公开发行流通受限-转增	-	26.01	67,468	-	1,754,842.68	注 1
002562	兄弟科技	2021 年 1 月 5 日	2021 年 7 月 8 日	非公开发行流通受限	4.71	4.17	1,486,200	7,000,002.00	6,197,454.00	-
300460	惠伦晶体	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 12 日	非公开发行流通受限	12.37	21.94	485,044	5,999,994.28	10,641,865.36	-
300497	富祥药业	2021 年 1 月 19 日	2021 年 7 月 21 日	非公开发行流通受限	12.68	12.31	630,914	7,999,989.52	7,766,551.34	-
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	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月	2021 年 07	新股流通	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

		12 日	月 21 日	受限						
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限-转增	-	27.42	108	-	2,961.36	注 2
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月	2021 年 9	新股流通	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

		11 日	月 22 日	受限						
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
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	2021 年 10	新股流通	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-

		7 日	月 15 日	受限						
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	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
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	2021 年 11	新股流通	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

		17 日	月 26 日	受限						
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 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
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	2021 年 12	新股流通	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-

		23 日	月 30 日	受限						
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
600059	古越龙山	2021 年 4 月 28 日	2021 年 10 月 26 日	非公开发行流通受限	9.31	12.15	644,468	5,999,997.08	7,830,286.20	-
600584	长电科技	2021 年 4 月 29 日	2021 年 10 月 26 日	非公开发行流通受限	28.30	35.44	212,014	5,999,996.20	7,513,776.16	-
600754	锦江酒店	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 22 日	非公开发行流通受限	44.60	54.68	179,372	7,999,991.20	9,808,060.96	-
601360	三六零	2021 年 1 月 6 日	2021 年 07 月 09	非公开发行流	12.93	12.11	541,376	6,999,991.68	6,556,063.36	-

			日	通受限						
603703	盛洋科技	2021年1月5日	2021年7月1日	非公开发行流通受限	9.61	12.70	832,466	7,999,998.26	10,572,318.20	-
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	-
688076	诺泰生物	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	新股流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-
688201	信安世纪	2021年4月13日	2021年10月21日	新股流通受限	26.78	45.41	2,129	57,014.62	96,677.89	-
688217	睿昂基因	2021年5月7日	2021年11月17日	新股流通受限	18.42	58.40	1,040	19,156.80	60,736.00	-
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	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688316	青云	2021	2021	新股	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-

	科技	年 3 月 5 日	年 9 月 16 日	流通受限						
688395	正弦电气	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-
688626	翔宇医疗	2021 年 3 月 23 日	2021 年 10 月 08 日	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688633	星球石墨	2021 年 3 月 17 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688665	四方光电	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
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 17 日	2021 年 7 月 1 日	新发未上市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-

注：1. 本基金持有的非公开发行股票高德红外，于 2021 年 6 月 1 日实施 2020 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派 2.5 元人民币现金（含税），同时，以资本公积金转增股本，每 10 股转增 4 股。本基金新增 67,468 股。

2. 本基金持有的新股流通受限股票冠中生态，于 2021 年 6 月 4 日实施 2020 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 0.80 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 108 股。

3. 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

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

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发行的证券，不得超过该证券的 10%，投资于单只基金市值不高于本基金资产净值的 20%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有除国债、政策性金融债和央行票据以外的按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	37,103,311.50	41,103,725.14
AAA 以下	17,484,049.40	28,528,097.00
未评级	-	-
合计	54,587,360.90	69,631,822.14

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及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在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的最短持有期限为 3 个月。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 个月（3 个月指 30 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。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。本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50% ，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

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	56,199,087.93	-	-	-	-	-	56,199,087.93
结算备付金	246,512.11	-	-	-	-	-	246,512.11
存出保证金	121,650.04	-	-	-	-	-	121,650.04
交易性金融资产	43,085,000.00	46,744,069.14	101,180,000.00	41,430,342.20	13,157,018.70	3,280,073,261.68	3,525,669,691.72
应收利息	-	-	-	-	-	3,259,391.72	3,259,391.72
应收申购款	102,899.19	-	-	-	-	4,961,193.40	5,064,092.59
应收证券清	-	-	-	-	-	18,859,50	18,859,505

算款						5.88	.88
资产总计	99,755,149.27	46,744,069.14	101,180,000.00	41,430,342.20	13,157,018.70	3,307,153,352.68	3,609,419,931.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,675,002.95	31,675,002.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,264,246.24	2,264,246.24
应付托管费	-	-	-	-	-	515,283.00	515,283.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	64,196.81	64,196.81
应交税费	-	-	-	-	-	608,943.29	608,943.29
其他负债	-	-	-	-	-	184,532.16	184,532.16
负债总计	-	-	-	-	-	35,312,204.45	35,312,204.45
利率敏感度缺口	99,755,149.27	46,744,069.14	101,180,000.00	41,430,342.20	13,157,018.70	3,271,841,148.23	3,574,107,727.54
上年度末 2020 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							
银行存款	104,872,965.90	-	-	-	-	-	104,872,965.90
结算备付金	688,047.43	-	-	-	-	-	688,047.43
存出保证金	164,281.15	-	-	-	-	-	164,281.15
交易性金融资产	-	-	219,453,120.56	54,041,078.30	15,590,743.84	4,004,905,688.45	4,293,990,631.15
应收利息	-	-	-	-	-	2,218,884.88	2,218,884.88
应收股利	-	-	-	-	-	1,291,189.10	1,291,189.10
应收申购款	306,431.07	-	-	-	-	21,202,076.83	21,508,507.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	48,876,290.80	48,876,290.80
资产总计	106,031,725.55	-	219,453,120.56	54,041,078.30	15,590,743.84	4,078,494,130.06	4,473,610,798.31
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,547,748.78	45,547,748.78
应付管理人	-	-	-	-	-	2,604,000	2,604,000.

报酬						.03	03
应付托管费	-	-	-	-	-	609,232.05	609,232.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	204,294.24	204,294.24
应交税费	-	-	-	-	-	200,247.96	200,247.96
其他负债	-	-	-	-	-	288,079.41	288,079.41
负债总计	-	-	-	-	-	49,453,602.47	49,453,602.47
利率敏感度缺口	106,031,725.55	-	219,453,120.56	54,041,078.30	15,590,743.84	4,029,040,527.59	4,424,157,195.84

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）	上年度末 （2020 年 12 月 31 日 ）
分析	利率 +1%	-878,562.06	-910,173.10
	利率 -1%	891,283.48	918,788.90

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格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。本基金主要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、证券交易所上市或银行间同业市场

交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

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（包括 QDII 基金和香港互认基金）的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金会将拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及混合型基金等，非权益类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场型基金等固收类资产。本基金的权益类资产投资比例中枢为 80%。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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		上年度末 2020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	229,980,336.78	6.43	259,116,831.72	5.86
交易性金融资产－基金投资	3,050,092,924.90	85.34	3,745,788,856.73	84.67
交易性金融资产－债券投资	245,596,430.04	6.87	289,084,942.70	6.53
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,525,669,691.72	98.64	4,293,990,631.15	97.06

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		
	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）	上年度末 （2020 年 12 月

			31 日 ）
分析	业绩比较基准+10%	257,701,658.80	369,092,604.81
	业绩比较基准-10%	-257,701,658.80	-369,092,604.81

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	229,980,336.78	6.37
	其中：股票	229,980,336.78	6.37
2	基金投资	3,050,092,924.90	84.50
3	固定收益投资	245,596,430.04	6.80
	其中：债券	245,596,430.04	6.80
	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	56,445,600.04	1.56
8	其他各项资产	27,304,640.23	0.76
9	合计	3,609,419,931.99	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	3,596,487.00	0.10

C	制造业	153,731,097.17	4.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,214,166.00	0.03
E	建筑业	1,004,719.44	0.03
F	批发和零售业	6,032,515.45	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	9,808,060.96	0.27
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,198,988.09	0.45
J	金融业	19,708,281.62	0.55
K	房地产业	10,147,541.00	0.28
L	租赁和商务服务业	1,650,514.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	2,117,880.10	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	940,097.34	0.03
R	文化、体育和娱乐业	3,774,260.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	229,980,336.78	6.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300460	惠伦晶体	485,044	10,641,865.36	0.30
2	603703	盛洋科技	832,466	10,572,318.20	0.30
3	000723	美锦能源	1,428,572	10,471,432.76	0.29
4	600754	锦江酒店	179,372	9,808,060.96	0.27
5	002139	拓邦股份	526,316	8,621,056.08	0.24
6	600059	古越龙山	644,468	7,830,286.20	0.22
7	300497	富祥药业	630,914	7,766,551.34	0.22
8	600584	长电科技	212,014	7,513,776.16	0.21
9	002415	海康威视	102,700	6,624,150.00	0.19
10	601360	三六零	541,376	6,556,063.36	0.18
11	002562	兄弟科技	1,486,200	6,197,454.00	0.17
12	002414	高德红外	236,138	6,141,949.38	0.17
13	000895	双汇发展	171,879	5,465,752.20	0.15
14	000785	居然之家	867,357	5,264,856.99	0.15

15	000002	万 科A	199,300	4,745,333.00	0.13
16	601166	兴业银行	206,000	4,233,300.00	0.12
17	603816	顾家家居	50,100	3,871,728.00	0.11
18	688099	晶晨股份	34,466	3,867,085.20	0.11
19	601658	邮储银行	683,700	3,432,174.00	0.10
20	601318	中国平安	52,600	3,381,128.00	0.09
21	688233	神工股份	61,454	3,318,516.00	0.09
22	600496	精工钢构	809,746	3,303,763.68	0.09
23	002050	三花智控	134,250	3,219,315.00	0.09
24	002142	宁波银行	80,516	3,137,708.52	0.09
25	600048	保利地产	255,200	3,072,608.00	0.09
26	601128	常熟银行	468,000	2,901,600.00	0.08
27	600309	万华化学	22,800	2,481,096.00	0.07
28	002475	立讯精密	53,000	2,438,000.00	0.07
29	600383	金地集团	227,500	2,329,600.00	0.07
30	002920	德赛西威	20,700	2,278,656.00	0.06
31	002841	视源股份	18,300	2,274,507.00	0.06
32	601601	中国太保	78,000	2,259,660.00	0.06
33	600426	华鲁恒升	71,630	2,216,948.50	0.06
34	601899	紫金矿业	226,000	2,189,940.00	0.06
35	601799	星宇股份	9,300	2,099,196.00	0.06
36	300760	迈瑞医疗	4,200	2,016,210.00	0.06
37	002851	麦格米特	64,125	2,002,623.75	0.06
38	300144	宋城演艺	118,900	1,997,520.00	0.06
39	600690	海尔智家	75,600	1,958,796.00	0.05
40	002001	新 和 成	67,872	1,946,568.96	0.05
41	300454	深信服	7,300	1,894,204.00	0.05
42	300413	芒果超媒	25,900	1,776,740.00	0.05
43	002311	海大集团	21,600	1,762,560.00	0.05
44	002027	分众传媒	175,400	1,650,514.00	0.05
45	603259	药明康德	10,440	1,634,799.60	0.05
46	600741	华域汽车	62,100	1,631,367.00	0.05
47	000333	美的集团	22,500	1,605,825.00	0.04
48	600031	三一重工	54,700	1,590,129.00	0.04
49	002429	兆驰股份	261,000	1,584,270.00	0.04
50	002007	华兰生物	42,000	1,540,560.00	0.04
51	600887	伊利股份	40,600	1,495,298.00	0.04
52	002555	三七互娱	62,200	1,494,044.00	0.04
53	603369	今世缘	27,400	1,483,984.00	0.04
54	002444	巨星科技	43,200	1,472,256.00	0.04
55	002938	鹏鼎控股	40,400	1,449,552.00	0.04
56	000651	格力电器	27,800	1,448,380.00	0.04

57	300271	华宇软件	73,600	1,416,800.00	0.04
58	601168	西部矿业	117,900	1,406,547.00	0.04
59	600900	长江电力	58,600	1,209,504.00	0.03
60	601012	隆基股份	12,320	1,094,508.80	0.03
61	002600	领益智造	116,300	1,068,797.00	0.03
62	300699	光威复材	13,500	1,025,325.00	0.03
63	000938	紫光股份	46,100	1,008,668.00	0.03
64	601668	中国建筑	213,700	993,705.00	0.03
65	000858	五 粮 液	3,300	983,037.00	0.03
66	603707	健友股份	23,400	976,950.00	0.03
67	000768	中航西飞	36,300	953,964.00	0.03
68	002044	美年健康	103,194	940,097.34	0.03
69	000538	云南白药	8,100	937,332.00	0.03
70	600276	恒瑞医药	13,200	897,204.00	0.03
71	002398	垒知集团	118,500	844,905.00	0.02
72	600521	华海药业	36,500	762,120.00	0.02
73	600050	中国联通	173,800	750,816.00	0.02
74	603368	柳药股份	34,500	681,030.00	0.02
75	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.02
76	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.01
77	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01
78	000001	平安银行	14,500	327,990.00	0.01
79	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.01
80	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.01
81	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.01
82	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
83	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
84	688201	信安世纪	2,129	96,677.89	0.00
85	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.00
86	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
87	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
88	688217	睿昂基因	1,040	60,736.00	0.00
89	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
90	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
91	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
92	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
93	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
94	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.00
95	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
96	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
97	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
98	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00

99	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
100	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
101	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
102	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
103	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
104	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
105	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
106	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
107	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
108	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
109	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
110	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
111	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
112	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
113	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
114	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
115	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
116	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
117	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
118	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
119	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
120	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
121	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
122	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
123	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
124	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
125	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
126	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
127	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
128	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
129	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
130	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
131	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
132	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
133	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
134	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
135	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
136	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
137	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
138	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
139	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
140	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00

141	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
142	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
143	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
144	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
145	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
146	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
147	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

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	000723	美锦能源	8,000,003.20	0.18
2	603703	盛洋科技	7,999,998.26	0.18
3	600754	锦江酒店	7,999,991.20	0.18
4	300497	富祥药业	7,999,989.52	0.18
5	002562	兄弟科技	7,000,002.00	0.16
6	601360	三六零	6,999,991.68	0.16
7	002139	拓邦股份	6,000,002.40	0.14
8	600059	古越龙山	5,999,997.08	0.14
9	600584	长电科技	5,999,996.20	0.14
10	300460	惠伦晶体	5,999,994.28	0.14
11	002414	高德红外	5,004,438.90	0.11
12	000002	万 科 A	1,597,202.00	0.04
13	688819	天能股份	1,186,083.78	0.03
14	600690	海尔智家	997,794.00	0.02
15	688233	神工股份	994,955.16	0.02
16	603707	健友股份	993,602.80	0.02
17	601318	中国平安	766,866.00	0.02
18	002044	美年健康	499,320.00	0.01
19	601168	西部矿业	498,934.00	0.01
20	601899	紫金矿业	498,800.00	0.01

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	600141	兴发集团	10,686,650.78	0.24
2	688099	晶晨股份	10,077,244.47	0.23
3	603229	奥翔药业	9,831,564.95	0.22
4	002891	中宠股份	9,367,381.88	0.21
5	600727	鲁北化工	9,114,866.80	0.21

6	688122	西部超导	6,178,198.96	0.14
7	603816	顾家家居	6,135,295.27	0.14
8	002782	可立克	5,605,793.01	0.13
9	000584	哈工智能	5,497,045.48	0.12
10	000050	深天马 A	5,214,841.40	0.12
11	300174	元力股份	4,548,655.80	0.10
12	600095	湘财股份	4,034,958.85	0.09
13	300017	网宿科技	3,989,962.00	0.09
14	300075	数字政通	3,138,105.02	0.07
15	600556	天下秀	3,036,623.35	0.07
16	600519	贵州茅台	2,939,509.00	0.07
17	601012	隆基股份	2,836,702.16	0.06
18	300999	金龙鱼	2,298,510.22	0.05
19	000858	五 粮 液	2,108,341.00	0.05
20	688819	天能股份	1,936,054.17	0.04

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	93,388,281.88
卖出股票收入（成交）总额	148,434,312.27

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	23,085,000.00	0.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	167,924,069.14	4.70
	其中：政策性金融债	167,924,069.14	4.70
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）	54,587,360.90	1.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	245,596,430.04	6.87

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	170206	17 国开 06	1,000,000	101,180,000.00	2.83
2	108604	国开 1805	466,182	46,744,069.14	1.31
3	019640	20 国债 10	230,850	23,085,000.00	0.65
4	200406	20 农发 06	200,000	20,000,000.00	0.56
5	132018	G 三峡 EB1	80,420	9,660,050.40	0.27

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：股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金是基金中基金，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%，同时，本基金会将拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及混合型基金等，非权益类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场型基金等固收类资产。

本基金原则上以权益类资产为主要投资方向，本基金的权益类资产投资比例中枢为 80%。通

过大类资产配置策略最终决定权益类基金在本基金组合中的占比。同时，在权益类基金内部，将根据不同的风险收益特征和投资风格对基金进行分类，建立相应的分析跟踪模型，在既定的投资范围和投资策略内进行基金类别比例的配置。

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	163415	兴全商业模式优选混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	33,764,245.93	133,503,828.41	3.74	是
2	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	39,624,126.64	130,244,504.27	3.64	否
3	163407	兴全沪深 300 指数(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	45,783,309.97	122,186,497.65	3.42	是
4	163417	兴全合宜混合(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	58,658,912.15	121,992,939.60	3.41	是
5	100032	富国中证红利指数增强 A	契约型开放式	99,974,970.81	115,571,066.26	3.23	否
6	169101	东方红	契约	46,306,064.87	112,431,125.50	3.15	否

		睿丰混合	型开放式				
7	510900	H 股 ETF	交易型开放式(ETF)	88,660,900.00	102,492,000.40	2.87	否
8	163412	兴全轻资产混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	24,885,957.31	95,935,365.43	2.68	是
9	168103	九泰锐益	上市契约型开放式(LOF)	47,018,892.00	95,119,218.52	2.66	否
10	163409	兴全绿色投资混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	41,245,354.07	93,585,708.38	2.62	是
11	166005	中欧价值发现混合 A	契约型开放式	41,422,729.65	85,769,904.01	2.40	否
12	007130	中庚小盘价值股票	契约型开放式	43,617,500.24	78,659,799.93	2.20	否
13	340006	兴全全球视野股票	契约型开放式	23,496,528.33	76,619,829.23	2.14	是
14	001256	泓德优选成长混合	契约型开放式	39,756,185.38	75,333,995.68	2.11	否
15	000020	景顺长城品质投资混合	契约型开放式	17,118,209.43	74,909,284.47	2.10	否

16	206002	鹏华精选成长混合	契约型开放式	24,768,041.82	72,248,377.99	2.02	否
17	070019	嘉实价值优势混合	契约型开放式	26,705,291.66	69,727,516.52	1.95	否
18	166009	中欧新动力混合(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	18,362,814.12	65,131,065.40	1.82	否
19	161017	富国中证 500 指数增强(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	26,442,162.16	64,677,528.64	1.81	否
20	159920	恒生 ETF	交易型开放式(ETF)	42,113,347.00	63,380,587.24	1.77	否
21	166001	中欧新趋势混合(LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	35,763,656.84	63,104,972.49	1.77	否
22	163402	兴全趋势投资混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	62,874,704.40	62,774,104.87	1.76	是
23	161131	易方达科润混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	50,068,943.00	58,380,387.54	1.63	否
24	160613	鹏华盛世创新	上市契约	41,031,438.34	57,361,950.80	1.60	否

		混合(LOF)	型开放式(LOF)				
25	001975	景顺长城环保优势股票	契约型开放式	14,803,672.16	56,401,990.93	1.58	否
26	518880	华安黄金易(ETF)	交易型开放式(ETF)	15,387,000.00	55,147,008.00	1.54	否
27	160142	南方优势产业混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	42,662,042.00	49,999,913.22	1.40	否
28	003949	兴全稳泰债券A	契约型开放式	46,659,435.61	49,934,927.99	1.40	是
29	340007	兴全社会责任混合	契约型开放式	7,654,765.40	48,883,331.84	1.37	是
30	166019	中欧价值智选混合A	契约型开放式	9,814,607.10	47,988,521.42	1.34	否
31	002015	南方荣光灵活配置混合A	契约型开放式	28,409,019.88	41,590,805.10	1.16	否
32	163411	兴全精选混合	契约型开放式	10,324,092.89	41,032,074.78	1.15	是
33	005062	博时中证500指数增强A	契约型开放式	25,966,091.80	39,837,178.04	1.11	否

34	008245	圆信永丰致优混合 A	契约型开放式	19,557,963.01	38,822,556.57	1.09	否
35	007802	兴全合泰混合 A	契约型开放式	19,323,032.85	36,839,362.13	1.03	是
36	005937	工银精选金融地产混合 A	契约型开放式	23,360,553.48	35,641,196.44	1.00	否
37	001330	鹏华弘实混合 C	契约型开放式	20,078,770.56	30,756,660.74	0.86	否
38	512090	易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易型开放式(ETF)	16,278,100.00	29,479,639.10	0.82	否
39	161125	易标普 500 指数(QDII-LOF)A	上市契约型开放式(LOF)	16,558,205.00	28,571,182.73	0.80	否
40	001835	易方达瑞祥混合 I	契约型开放式	20,490,983.61	28,011,174.59	0.78	否
41	511880	银华交易型货币 A	交易型开放式(ETF)	266,500.00	26,967,668.00	0.75	否
42	501186	华夏兴融混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	23,219,228.00	25,332,177.75	0.71	否
43	090013	大成竞争优势	契约型开	16,569,179.78	23,660,788.73	0.66	否

		混合	放式				
44	168105	九泰泰富	上市契约型开放式(LOF)	11,246,816.00	23,337,143.20	0.65	否
45	511990	华宝添益货币A	交易型开放式(ETF)	233,135.00	23,311,868.06	0.65	否
46	501076	鹏华科创3年封闭混合	上市契约型开放式(LOF)	13,626,390.00	21,665,960.10	0.61	否
47	501085	财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合	契约型开放式	14,731,703.00	21,095,798.70	0.59	否
48	005775	中加转型动力混合A	契约型开放式	8,545,120.49	20,536,488.07	0.57	否
49	002232	华夏新趋势混合C	契约型开放式	14,781,966.00	20,325,203.25	0.57	否
50	501073	华安科创主题混合	上市契约型开放式(LOF)	14,255,305.00	16,778,493.99	0.47	否
51	161728	招商瑞智优选混合(LOF)	上市契约型开放式	14,216,298.00	16,588,998.14	0.46	否

			(LOF)				
52	240022	华宝资源优选混合 A	契约型开放式	4,960,719.83	14,723,416.46	0.41	否
53	501075	万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合 A	上市契约型开放式(LOF)	5,998,694.00	11,331,532.97	0.32	否
54	510100	易方达上证 50ETF	交易型开放式(ETF)	6,689,400.00	9,264,819.00	0.26	否
55	515080	招商中证红利 ETF	交易型开放式(ETF)	4,580,900.00	6,495,716.20	0.18	否
56	501080	中金科创主题混合	上市契约型开放式(LOF)	3,169,020.00	5,650,362.66	0.16	否
57	501093	华夏翔阳两年定开混合	上市契约型开放式(LOF)	1,635,334.00	2,843,845.83	0.08	否
58	501078	广发科创主题 3 年封闭混合	上市契约型开放式(LOF)	960,484.00	2,050,633.34	0.06	否
59	501082	博时科创主题	上市契约	740,277.00	1,519,788.68	0.04	否

		3 年封闭混合	型开放式(LOF)				
60	501081	中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合	上市契约型开放式(LOF)	730,100.00	1,341,193.70	0.04	否
61	501083	银华科创主题 3 年封闭混合	上市契约型开放式(LOF)	651,800.00	1,209,740.80	0.03	否
62	161911	万家强债	上市契约型开放式(LOF)	1,113,856.00	1,113,856.00	0.03	否
63	161837	银华大盘	上市契约型开放式(LOF)	553,000.00	1,094,940.00	0.03	否
64	160526	博时优势	上市契约型开放式(LOF)	536,812.00	730,064.32	0.02	否
65	501088	嘉实瑞虹三年定期混合	上市契约型开放式(LOF)	340,100.00	528,515.40	0.01	否
66	160527	研究优选	上市契约型开	482,150.00	490,828.70	0.01	否

			放式(LOF)				
67	161912	社会责任	上市契约型开放式(LOF)	12,800.00	24,000.00	0.00	否

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，国家开发银行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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	121,650.04
2	应收证券清算款	18,859,505.88
3	应收股利	-
4	应收利息	3,259,391.72
5	应收申购款	5,064,092.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,304,640.23

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132018	G 三峡 EB1	9,660,050.40	0.27
2	113037	紫银转债	9,450,372.00	0.26
3	110059	浦发转债	7,792,874.40	0.22
4	127005	长证转债	6,394,672.60	0.18

5	110043	无锡转债	5,237,366.40	0.15
6	113011	光大转债	4,623,200.00	0.13
7	110053	苏银转债	2,733,027.20	0.08
8	113026	核能转债	2,192,840.20	0.06
9	113044	大秦转债	1,744,324.50	0.05
10	110051	中天转债	1,430,781.80	0.04
11	128063	未来转债	985,217.20	0.03
12	128048	张行转债	380,312.00	0.01

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300460	惠伦晶体	10,641,865.36	0.30	非公开发行流通受限
2	603703	盛洋科技	10,572,318.20	0.30	非公开发行流通受限
3	000723	美锦能源	10,471,432.76	0.29	非公开发行流通受限
4	600754	锦江酒店	9,808,060.96	0.27	非公开发行流通受限
5	002139	拓邦股份	8,621,056.08	0.24	非公开发行流通受限
6	600059	古越龙山	7,830,286.20	0.22	非公开发行流通受限
7	300497	富祥药业	7,766,551.34	0.22	非公开发行流通受限
8	600584	长电科技	7,513,776.16	0.21	非公开发行流通受限
9	601360	三六零	6,556,063.36	0.18	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

持有人户数（户）	户均持有的基金份	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

	额	持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
71,242	34,446.58	236,919,109.69	9.65	2,217,124,435.97	90.35

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	8,485,545.07	0.3458

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>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

基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,978,308,637.71
本报告期期初基金份额总额	3,212,939,287.60
本报告期基金总申购份额	749,120,325.93
减：本报告期基金总赎回份额	1,508,016,067.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	2,454,043,545.66

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）报告期内基金管理人无重大人事变动。

（2）报告期内，本基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”） 根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	3	66,667,376.86	42.13%	42,323.25	32.76%	-
申万宏源证券	1	64,264,152.09	40.61%	61,433.10	47.55%	-
国泰君安	1	14,702,974.02	9.29%	13,693.71	10.60%	-
中信建投证券	1	12,624,971.26	7.98%	11,758.06	9.10%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	5,321,440.07	24.96%	-	-	-	-	71,580,866.56	12.44%
申万宏源证券	15,997,692.80	75.04%	-	-	-	-	382,873,245.56	66.56%
国泰君安	-	-	-	-	-	-	56,857,208.09	9.88%
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	63,890,060.32	11.11%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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兄弟科技(002562)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-01-07
2	关于旗下部分基金投资盛洋科技(603703)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-01-07
3	关于旗下部分基金投资三六零(601360)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-01-08
4	关于增加北京汇成基金销售有限公司、长量基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-01-14
5	关于旗下部分基金投资富祥药业(300497)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-01-21
6	关于旗下部分基金投资美锦能源(000723)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-01-30
7	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-02-09
8	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-03-05
9	关于旗下部分基金投资锦江酒店	中国证券报、规定互联	2021-03-25

	(600754)非公开发行股票的公告	网网站	
10	关于旗下部分基金投资高德红外(002414)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-04-28
11	关于旗下部分基金投资古越龙山(600059)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-04-30
12	关于旗下部分基金投资长电科技(600584)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-05-06
13	关于旗下部分基金投资惠伦晶体(300460)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-05-11
14	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-05-19
15	关于旗下部分基金投资拓邦股份(002139)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联网网站	2021-06-03
16	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	中国证券报、规定互联网网站	2021-06-16
17	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	中国证券报、规定互联网网站	2021-06-17
18	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、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

本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 个月。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 个月（3 个月指 30 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 个月内无法赎回的风险。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会关于准予兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复文件

（二）《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》

（三）《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件和营业执照

（六）基金托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会规定的其它文件

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