

兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
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	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	54
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	54

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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	兴全汇享一年持有期混合	
基金主代码	009611	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 7 月 8 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,511,754,597.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全汇享一年持有混合 A	兴全汇享一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	009611	009612
报告期末下属分级基金的份额总额	1,283,966,971.43 份	227,787,626.41 份

注：1、本基金每份基金份额的最短持有期为 1 年。

2、若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否暂停申购及赎回业务，具体以届时提前发布的公告为准。

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，把握股票市场、债券市场的投资机会，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、债券类属资产配置、债券投资组合策略、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、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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×10%+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×85%
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	兴业银行股份有限公司
信息披露 姓名	杨卫东	李真

负责人	联系电话	021-20398888	021-52629999-212051
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95561
传真		021-20398858	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		201204	200120
法定代表人		杨华辉	吕家进

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 28-29 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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	兴全汇享一年持有混合 A	兴全汇享一年持有混合 C
本期已实现收益	-40,321,542.33	-6,961,746.35
本期利润	-73,936,414.29	-11,760,700.39
加权平均基金份额本期利润	-0.0532	-0.0504
本期加权平均净值利润率	-4.83%	-4.60%
本期基金份额净值增长率	-4.11%	-4.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利	137,193,539.40	23,334,556.66

润		
期末可供分配基金份额利润	0.1069	0.1024
期末基金资产净值	1,421,160,510.83	251,122,183.07
期末基金份额净值	1.1069	1.1024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	10.69%	10.24%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可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

兴全汇享一年持有混合 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	1.89%	0.38%	0.89%	0.17%	1.00%	0.21%
过去三个月	1.74%	0.47%	1.19%	0.21%	0.55%	0.26%
过去六个月	-4.11%	0.47%	-0.54%	0.24%	-3.57%	0.23%
过去一年	3.06%	0.39%	-0.91%	0.20%	3.97%	0.19%

自基金合同生效起 至今	10.69%	0.35%	0.78%	0.18%	9.91%	0.17%
----------------	--------	-------	-------	-------	-------	-------

兴全汇享一年持有混合 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	1.87%	0.38%	0.89%	0.17%	0.98%	0.21%
过去三个月	1.68%	0.47%	1.19%	0.21%	0.49%	0.26%
过去六个月	-4.21%	0.47%	-0.54%	0.24%	-3.67%	0.23%
过去一年	2.85%	0.39%	-0.91%	0.20%	3.76%	0.19%
自基金合同生效起 至今	10.24%	0.35%	0.78%	0.18%	9.46%	0.17%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×10%+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×85%。其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。本基金选择该指数来衡量港股股票投资部分的绩效。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。

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：

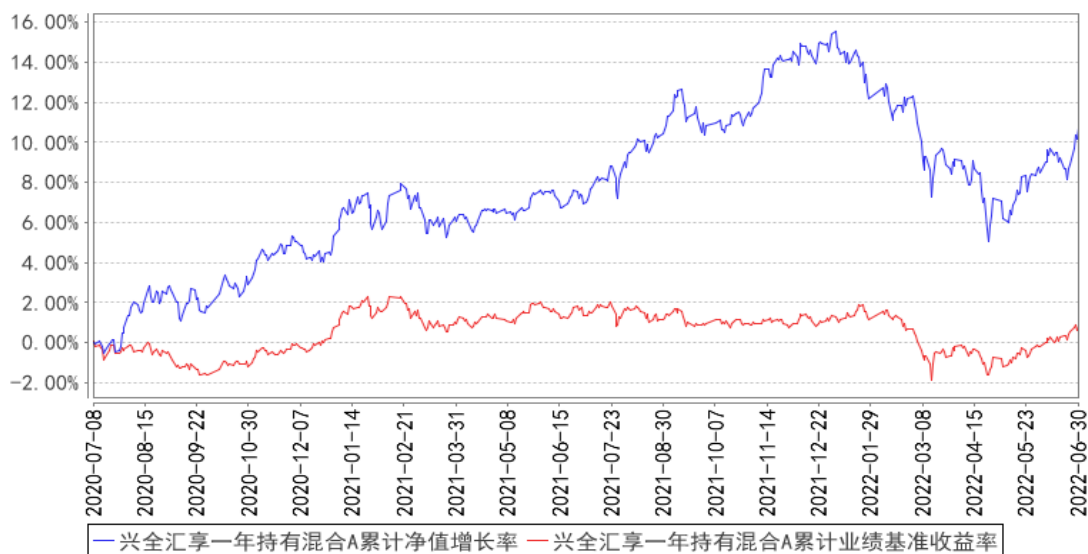
$$\text{Return}_t = 10\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 85\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

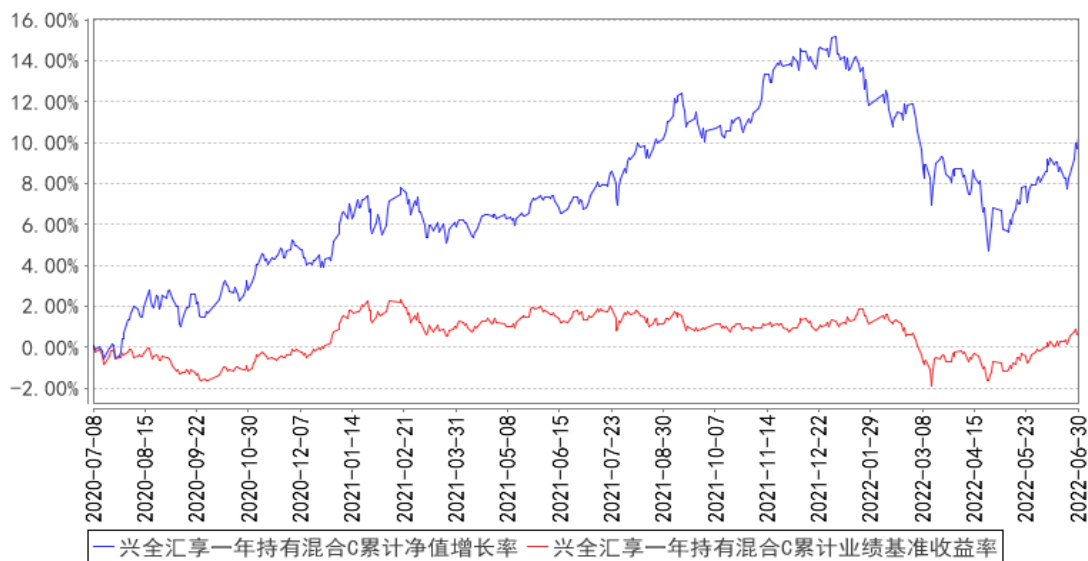
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

兴全汇享一年持有混合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



兴全汇享一年持有混合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 2022 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全汇享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 2020 年 07 月 08 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3.3 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”。

截止2022年6月30日，公司旗下共50只基金，品种涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、FOF等不同类型，建立了覆盖高中低等级的公募基金产品线，为各类风险偏好的投资者提供便捷、专业的投资理财服务。

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		
翟秀华	固定收益部副总监，兴全添利宝货币市场基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、	2020年7月8日	-	12年	硕士，历任毕马威华振会计师事务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴证全球基金管理有限公司研究员兼基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理。

	兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金、兴证全球恒利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理				
叶峰	兴全汇享一年持有期混合型基金经理	2021 年 12 月 20 日	-	5 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、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

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全汇享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，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

2022 年上半年，国内国际形势变化较快。海外一方面强劲复苏，通胀迭创新高，外围央行大幅收紧流动性，对抗通胀压力；一方面地缘政治冲突带来供应链的意外扰动和需求端的不确定性。国内结构性压力依然凸显，叠加疫情冲击，内需较为疲弱；实体融资需求疲弱，信贷投放承压。政策层面，货币政策较为友好，资金流动性宽裕；财政刺激力度增长，着力解决需求问题。在此背景下，债券市场表现较好，曲线陡峭下行；权益类资产则大幅波动，呈现深 V 走势。运作期内，本基金的配置结构较为均衡，阶段性调整资产配置比例，择券层面的策略有待优化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全汇享一年持有混合 A 的基金份额净值为 1.1069 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.11%，同期业绩比较基准收益率为-0.54%；截至本报告期末兴全汇享一年持有混合 C 的基金份额净值为 1.1024 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.21%，同期业绩比较基准收益率为-0.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6 月份以来，国内经济虽维持复苏，但复苏动能和持续性较弱。展望下半年，疫情扩散下，内需依然看不到明显的向上弹性，地产产业链的影响依然较大。欧洲在地区冲突和通胀压力下，经济已经略显疲态，其他发达经济体的向好势头也逐渐平缓，全球经济都出现乏力迹象。在此情况下，国内货币政策继续维持偏松的概率依然较大，债券市场的环境依然友好，但市场已经形成了较强的一致预期，债券市场下半年或将有较大的振幅。权益资产方面，我们仍然看好部分供给受限、需求平稳、低估值高股息的资源类品种，我们认为在不明朗的市场环境中，这一类资产的托底效应仍然会存在。此外，我们认为，电新相关的品种，目前市场的交易拥挤程度明显上升，而产能在不断投入，需要以更清醒的视角去看待，提防过剩的风险，长期发展向好的行业存在机会，但是会存在分化。另一方面，以电子为代表的成长板块，过去较长一段时间，受景气度下行的影响，估值和业绩的调整相对明显，在这一领域能找到不少估值业绩匹配程度更好、未来空间较大的公司，我们相对看好未来一段时间的投资价值。

本基金将在控制好风险的前提下，以优选个券、做好组合配置的动态调整为主，努力为投资

人创造合理回报。

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《基金法》、《兴全汇享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，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的

监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,539,793.90	10,897,295.45
结算备付金		4,545,237.53	4,535,762.81
存出保证金		321,701.12	249,293.59
交易性金融资产	6.4.7.2	1,922,631,430.37	2,228,571,158.67
其中：股票投资		362,389,351.40	417,975,541.46
基金投资		-	-
债券投资		1,560,242,078.97	1,810,595,617.21
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	32,000,106.03	5,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		6,291,111.56	10,340,945.08
应收股利		914,752.16	-
应收申购款		241,115.61	321,779.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	23,459,899.86
资产总计		1,977,485,248.28	2,283,376,135.18

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		289,912,292.31	266,399,351.95
应付清算款		10,564,787.63	5,083,292.66
应付赎回款		3,031,312.27	5,238,697.71
应付管理人报酬		1,028,000.83	1,281,138.49
应付托管费		137,066.78	170,818.49
应付销售服务费		40,865.40	44,442.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		119,102.01	109,535.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	369,127.15	1,120,558.19
负债合计		305,202,554.38	279,447,835.46
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,511,754,597.84	1,736,740,944.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	160,528,096.06	267,187,355.67
净资产合计		1,672,282,693.90	2,003,928,299.72
负债和净资产总计		1,977,485,248.28	2,283,376,135.18

注：1. 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，兴全汇享一年持有混合 A 基金份额净值 1.1069，基金份额总额 1,283,966,971.43 份；兴全汇享一年持有混合 C 基金份额净值 1.1024，基金份额总额 227,787,626.41 份。兴全汇享一年持有期混合份额总额合计为 1,511,754,597.84 份。

2. 以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号(年度报告和中期报告)》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

一、营业总收入		-75,200,140.18	122,221,879.93
1. 利息收入		150,820.80	87,994,950.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	94,547.80	207,928.08
债券利息收入		-	87,302,604.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,273.00	484,417.67
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-36,937,134.98	96,010,940.37
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-88,707,151.47	75,785,884.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	48,382,253.24	16,973,665.56
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,387,763.25	3,251,390.32
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-38,413,826.00	-61,784,010.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		10,496,974.50	31,926,401.90
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,662,225.33	17,152,280.63
2. 托管费	6.4.10.2.2	888,296.72	2,286,970.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	254,129.41	178,566.91
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		2,510,374.37	10,424,291.40
其中：卖出回购金融资产支出		2,510,374.37	10,424,291.40
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		70,978.52	212,024.06
8. 其他费用	6.4.7.23	110,970.15	1,672,268.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-85,697,114.68	90,295,478.03
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-85,697,114.68	90,295,478.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-85,697,114.68	90,295,478.03

注：以上比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号（年度报告和中期报告）》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,736,740,944.05	-	267,187,355.67	2,003,928,299.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,736,740,944.05	-	267,187,355.67	2,003,928,299.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-224,986,346.21	-	-106,659,259.61	-331,645,605.82
(一)、综合收益总额	-	-	-85,697,114.68	-85,697,114.68
(二)、本期基	-224,986,346.21	-	-20,962,144.93	-245,948,491.14

金份额 交易产生的 基金净值 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	42,361,423.30	-	5,273,660.27	47,635,083.57
2 .基金赎 回款	-267,347,769.51	-	-26,235,805.20	-293,583,574.71
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	1,511,754,597.84	-	160,528,096.06	1,672,282,693.90
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	4,313,364,042.41	-	228,466,681.05	4,541,830,723.46
加:会计 政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	4,313,364,042.41	-	228,466,681.05	4,541,830,723.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	17,643,278.10	-	91,466,687.49	109,109,965.59
(一)、综合收益总额	-	-	90,295,478.03	90,295,478.03
(二)、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)	17,643,278.10	-	1,171,209.46	18,814,487.56
其中:1.基金申购款	17,643,278.10	-	1,171,209.46	18,814,487.56
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	4,331,007,320.51	-	319,933,368.54	4,650,940,689.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2020]891 号文的核准,由兴证全球基金管理有限公司作为管理人于 2020 年 7 月 1 日至 2020 年 7 月 15 日向社会公开募集,首次设立募集规模为 4,285,402,676.26 份基金份额;基金合同于 2020 年 7 月 8 日生效。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为兴证全球基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。(以下简称“兴业银行”)。

本基金基金份额分为 A、C 类,A 类基金份额收取认(申)购费,不计提销售服务费;C 类基金份额不收取认(申)购费,但计提销售服务费。

本基金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)、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×10%+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×85%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2022年6月30日的财务状况以及2022年1月1日至2022年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金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不一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。本基金在编制本中期财务报表时已采用该准则,并采用准则允许的实务简便方法,调整期初基金净值,2021年的比较数据将不作重述。

金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产;

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 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；

(6) 公允价值变动收益系本基金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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务,即在客户取得服务控制权时确认收入。于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0 元。

本基金执行新金融工具准则的影响如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款、应付利息、应付交易费用和其他负债,金额分别为人民币 10,897,295.45 元、人民币 4,535,762.81 元、人民币 249,293.59 元、人民币 5,000,000.00 元、人民币 23,459,899.86 元、人民币 266,399,351.95 元、人民币 266,484.99 元、人民币 674,073.20 元和人民币 180,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中,并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等项目中,不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下,银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款和其他负债的金额分别为人民币 10,903,578.68 元、人民币 4,538,680.99 元、人民币 249,422.76 元、人民币 4,996,498.63 元、人民币 266,665,836.94 元和人民币 854,073.20 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 2,228,571,158.67 元,归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 23,454,070.65 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产,金额为人民币 2,252,025,229.32 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3%调整为 1%;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(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、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,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,暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自 2008 年 10 月 9 日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自 2013 年 1 月 1 日起,证券投资基金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,暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;对基金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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定,自 2015 年 9 月 8 日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	10,539,793.90
等于：本金	10,538,415.54
加：应计利息	1,378.36
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	10,539,793.90

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	350,046,722.39	-	362,389,351.40	12,342,629.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	875,031,655.62	12,744,093.91	880,803,745.07	-6,972,004.46
	银行间市场	671,887,137.52	10,303,033.90	679,438,333.90	-2,751,837.52
	合计	1,546,918,793.14	23,047,127.81	1,560,242,078.97	-9,723,841.98
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,896,965,515.53	23,047,127.81	1,922,631,430.37	2,618,787.03	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	32,000,106.03	-
银行间市场	-	-
合计	32,000,106.03	-

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持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本报告期末本基金无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	279,867.00
其中：交易所市场	274,569.87
银行间市场	5,297.13
应付利息	-
预提审计费用	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	369,127.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全汇享一年持有混合 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,501,443,415.73	1,501,443,415.73
本期申购	30,897,335.83	30,897,335.83
本期赎回（以“-”号填列）	-248,373,780.13	-248,373,780.13
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,283,966,971.43	1,283,966,971.43

兴全汇享一年持有混合 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,297,528.32	235,297,528.32
本期申购	11,464,087.47	11,464,087.47
本期赎回（以“-”号填列）	-18,973,989.38	-18,973,989.38
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	227,787,626.41	227,787,626.41

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴全汇享一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	228,779,043.52	2,912,076.25	231,691,119.77
本期利润	-40,321,542.33	-33,614,871.96	-73,936,414.29
本期基金份额交易产生的变动数	-29,249,101.58	8,687,935.50	-20,561,166.08
其中：基金申购款	4,670,439.60	-773,704.31	3,896,735.29
基金赎回款	-33,919,541.18	9,461,639.81	-24,457,901.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	159,208,399.61	-22,014,860.21	137,193,539.40

兴全汇享一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	35,032,660.86	463,575.04	35,496,235.90
本期利润	-6,961,746.35	-4,798,954.04	-11,760,700.39
本期基金份额交易产生的变动数	-846,489.72	445,510.87	-400,978.85
其中：基金申购款	1,676,283.46	-299,358.48	1,376,924.98
基金赎回款	-2,522,773.18	744,869.35	-1,777,903.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,224,424.79	-3,889,868.13	23,334,556.66

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	40,337.99
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	51,008.57
其他	3,201.24
合计	94,547.80

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-88,707,151.47
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	-88,707,151.47

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	633,594,080.46
减：卖出股票成本总额	720,573,009.83
减：交易费用	1,728,222.10
买卖股票差价收入	-88,707,151.47

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	26,567,440.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,814,812.77
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	48,382,253.24

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,336,758,570.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	1,299,207,921.64

本总额	
减：应计利息总额	15,699,967.61
减：交易费用	35,868.30
买卖债券差价收入	21,814,812.77

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,387,763.25
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	3,387,763.25

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-38,413,826.00
股票投资	-3,636,369.60
债券投资	-34,777,456.40
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	-38,413,826.00

6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	6,860.00
账户维护费用	14,550.00
其他费用	300.00
合计	110,970.15

6.4.7.24 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”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	170,210,000.84	13.39	395,743,244.99	42.66

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	104,811,904.18	9.27	799,304,805.09	61.88

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	269,503,000.00	5.58	4,889,797,000.00	45.63

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022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	125,342.82	15.15	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	292,512.47	46.45	99,971.26	30.84

注：基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,662,225.33	17,152,280.63
其中：支付销售机构的客户维护费	2,869,054.60	7,527,584.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	888,296.72	2,286,970.73

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全汇享一年持有混合 A	兴全汇享一年持有混合 C	合计
兴业银行	-	141,799.43	141,799.43
兴业证券	-	4,092.47	4,092.47
兴证全球基金	-	8,813.12	8,813.12
合计	-	154,705.02	154,705.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全汇享一年持有混合 A	兴全汇享一年持有混合 C	合计
兴证全球基金	-	14,273.30	14,273.30
兴业银行	-	1,043.07	1,043.07

兴业证券	-	6,262.29	6,262.29
合计	-	21,578.66	21,578.66

注：A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.20% 的费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.20%/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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	30,088,098.90	-	-	-	135,090,000.00	155,848.67

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本报告期内及上年度可比期间基金管理人均无运用固有资金投资本基金的情况。

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：无。

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
兴业银行	10,539,793.90	40,337.99	39,199,990.69	104,545.02

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,225	42,642.25	19,771.50	-
301109	军信股份	2022年6月17日	3-4个月	新股流通受限-转增	-	16.14	612	-	9,877.68	注1
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-

301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股流 通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301200	大族数控	2022年 2月18日	6个月	新股流 通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301207	华兰疫苗	2022年 2月10日	6个月	新股流 通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301212	联盛化学	2022年 4月7日	6个月	新股流 通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022年 2月28日	6个月	新股流 通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301237	和顺科技	2022年 3月16日	6个月	新股流 通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301238	瑞泰新材	2022年 6月10日	6个月	新股流 通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301259	艾布鲁	2022年 4月18日	6个月	新股流 通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301268	铭利达	2022年 3月29日	6个月	新股流 通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
600938	中国海油	2022年 4月14日	6个月	新股流 通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688173	希荻微	2022年 1月13日	6个月	新股流 通受限	33.57	31.62	4,236	142,202.52	133,942.32	-
688213	思特威	2022年 5月13日	6个月	新股流 通受限	31.51	49.01	14,046	442,589.46	688,394.46	-

注：1、本基金持有的新股流通受限股票军信股份，于 2022 年 6 月 17 日实施 2021 年年度权益分派方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 3.80 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 612 股。

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证券。

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 58,837,168.59 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 4 日	101.06	600,000	60,634,619.18
合计				600,000	60,634,619.18

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 231,075,123.72 元，于 2022 年 7 月 1 日、7 月 4 日、7 月 6 日、7 月 14 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	20,815,112.33	-
A-1 以下	-	-
未评级	129,681,507.68	44,032,000.00
合计	150,496,620.01	44,032,000.00

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。

6.4.13.2.2 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	752,116,442.56	698,512,872.30
AAA 以下	466,352,947.44	650,443,744.91
未评级	-	-
合计	1,218,469,390.00	1,348,956,617.21

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	59,086,036.92	185,227,000.00
合计	59,086,036.92	185,227,000.00

注：此处为主体信用评级。

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 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、买入返售金融资产及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	10,539,793.90	-	-	-	-	-	10,539,793.90
结算备付金	4,545,237.53	-	-	-	-	-	4,545,237.53
存出保证金	321,701.12	-	-	-	-	-	321,701.12
交易性金融资产	48,539,787.67	246,236,056.73	513,754,872.93	601,984,430.65	149,726,930.99	362,389,351.40	1,922,631,430.37
买入返售金融资产	32,000,106.03	-	-	-	-	-	32,000,106.03
应收股利	-	-	-	-	-	914,752.16	914,752.16
应收申购款	159.99	-	-	-	-	240,955.62	241,115.61
应收清算款	-	-	-	-	-	6,291,111.56	6,291,111.56
资产总计	95,946,786.24	246,236,056.73	513,754,872.93	601,984,430.65	149,726,930.99	369,836,170.74	1,977,485,248.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,031,312.27	3,031,312.27
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,028,000.83	1,028,000.83
应付托管费	-	-	-	-	-	137,066.78	137,066.78
应付清算款	-	-	-	-	-	10,564,787.63	10,564,787.63
卖出回购金融资产款	289,912,292.31	-	-	-	-	-	289,912,292.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-	40,865.40	40,865.40
应交税费	-	-	-	-	-	119,102.01	119,102.01
其他负债	-	-	-	-	-	369,127.15	369,127.15

负债总计	289,912,292 .31	-	-	-	-	15,290,26 2.07	305,202,55 4.38
利率敏感度 缺口	-193,965,50 6.07	246,236,0 56.73	513,754,872 .93	601,984, 430.65	149,726,9 30.99	354,545,9 08.67	1,672,282, 693.90
上年度末 2021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	10,897,295. 45	-	-	-	-	-	10,897,295 .45
结算备付金	4,535,762.8 1	-	-	-	-	-	4,535,762. 81
存出保证金	249,293.59	-	-	-	-	-	249,293.59
交易性金融 资产	4,032,000.0 0	30,197,00 0.00	660,384,763 .20	888,203, 274.58	227,778,5 79.43	417,975,5 41.46	2,228,571, 158.67
买入返售金 融资产	5,000,000.0 0	-	-	-	-	-	5,000,000. 00
应收申购款	2,579.91	-	-	-	-	319,199.8 1	321,779.72
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	10,340,94 5.08	10,340,945 .08
其他资产	-	-	-	-	-	23,459,89 9.86	23,459,899 .86
资产总计	24,716,931. 76	30,197,00 0.00	660,384,763 .20	888,203, 274.58	227,778,5 79.43	452,095,5 86.21	2,283,376, 135.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,238,697 .71	5,238,697. 71
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	1,281,138 .49	1,281,138. 49
应付托管费	-	-	-	-	-	170,818.4 9	170,818.49
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	5,083,292 .66	5,083,292. 66
卖出回购金 融资产款	264,399,351 .95	2,000,000 .00	-	-	-	-	266,399,35 1.95
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	44,442.67	44,442.67
应交税费	-	-	-	-	-	109,535.3 0	109,535.30
其他负债	-	-	-	-	-	1,120,558 .19	1,120,558. 19
负债总计	264,399,351 .95	2,000,000 .00	-	-	-	13,048,48 3.51	279,447,83 5.46

利率敏感度	-239,682,42	28,197,00	660,384,763	888,203,	227,778,5	439,047,1	2,003,928,
缺口	0.19	0.00	.20	274.58	79.43	02.70	299.72

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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)	
分析	利率 +1%	-9,492,711.96	-21,873,766.40
	利率 -1%	9,781,707.38	23,182,059.86

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-	11,205,170.59	-	11,205,170.59
资产合计	-	11,205,170.59	-	11,205,170.59
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	-	11,205,170.59	-	11,205,170.59

额				
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	12,773,528.32	-	12,773,528.32
资产合计	-	12,773,528.32	-	12,773,528.32
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	12,773,528.32	-	12,773,528.32

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民 币升值 5%	560,258.53	638,676.42
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-560,258.53	-638,676.42

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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%—40%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%）；同业存单投资占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终，在扣除股

指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	362,389,351.40	21.67	417,975,541.46	20.86
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,560,242,078.97	93.30	1,810,595,617.21	90.35
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	1,922,631,430.37	114.97	2,228,571,158.67	111.21

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		
	本基金业绩比较基准变化 10%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 10%	263,733,515.52	339,131,955.89
业绩比较基准下降 10%	-263,733,515.52	-339,131,955.89	

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。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	683,877,665.86	744,749,088.72
第二层次	1,236,215,562.10	1,481,040,167.69
第三层次	2,538,202.41	2,781,902.26
合计	1,922,631,430.37	2,228,571,158.67

注：根据中国证监会 2022 年 5 月 26 日发布的证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号《年度报告和中期报告》模板，本基金对上年度末公允价值层次进行追溯调整。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值 and 账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	362,389,351.40	18.33
	其中：股票	362,389,351.40	18.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,560,242,078.97	78.90
	其中：债券	1,560,242,078.97	78.90
	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	32,000,106.03	1.62
	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	15,085,031.43	0.76
8	其他各项资产	7,768,680.45	0.39
9	合计	1,977,485,248.28	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 11,205,170.59 元，占净值比例 0.67%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	145,873,143.35	8.72
C	制造业	172,942,937.29	10.34
D	电力、热力、燃气及水生产和	-	-

	供应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,572,535.60	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	148,205.60	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	25,575,356.00	1.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	30,307.77	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	41,695.20	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	-	-
	合计	351,184,180.81	21.00

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	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
能源	11,205,170.59	0.67
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	11,205,170.59	0.67

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	600938	中国海油	835,505	14,445,995.89	0.86
1	00883	中国海洋石油	1,264,725	11,205,170.59	0.67
2	600703	三安光电	921,809	22,658,065.22	1.35
3	601088	中国神华	668,200	22,251,060.00	1.33
4	600188	兖矿能源	561,997	22,187,641.56	1.33

5	002244	滨江集团	2,372,300	20,520,395.00	1.23
6	600256	广汇能源	1,886,600	19,884,764.00	1.19
7	000983	山西焦煤	1,406,500	18,833,035.00	1.13
8	603986	兆易创新	103,300	14,690,293.00	0.88
9	603799	华友钴业	140,440	13,428,872.80	0.80
10	002993	奥海科技	272,168	11,311,302.08	0.68
11	601666	平煤股份	765,700	10,405,863.00	0.62
12	000683	远兴能源	898,000	9,437,980.00	0.56
13	002938	鹏鼎控股	293,100	8,854,551.00	0.53
14	600745	闻泰科技	98,400	8,374,824.00	0.50
15	002475	立讯精密	240,800	8,136,632.00	0.49
16	002600	领益智造	1,566,900	7,865,838.00	0.47
17	601899	紫金矿业	814,130	7,595,832.90	0.45
18	600988	赤峰黄金	469,800	7,493,310.00	0.45
19	600690	海尔智家	255,568	7,017,897.28	0.42
20	601898	中煤能源	670,800	6,962,904.00	0.42
21	603733	仙鹤股份	250,000	6,650,000.00	0.40
22	002415	海康威视	183,062	6,626,844.40	0.40
23	002120	韵达股份	385,260	6,572,535.60	0.39
24	300529	健帆生物	121,800	6,198,402.00	0.37
25	600123	兰花科创	366,800	6,033,860.00	0.36
26	601001	晋控煤业	321,900	5,713,725.00	0.34
27	600779	水井坊	60,000	5,552,400.00	0.33
28	603707	健友股份	187,600	5,290,320.00	0.32
29	603501	韦尔股份	29,300	5,069,779.00	0.30
30	001914	招商积余	281,300	5,054,961.00	0.30
31	600782	新钢股份	940,862	4,741,944.48	0.28
32	600985	淮北矿业	279,200	4,065,152.00	0.24
33	600808	马钢股份	1,040,200	3,942,358.00	0.24
34	002975	博杰股份	96,200	3,679,650.00	0.22
35	603989	艾华集团	110,103	3,104,904.60	0.19
36	603822	嘉澳环保	50,000	2,339,500.00	0.14
37	300601	康泰生物	49,920	2,255,385.60	0.13
38	300305	裕兴股份	150,000	2,127,000.00	0.13
39	300791	仙乐健康	50,000	1,561,000.00	0.09
40	688766	普冉股份	6,315	1,030,165.95	0.06
41	688213	思特威	14,046	688,394.46	0.04
42	688173	希荻微	4,236	133,942.32	0.01
43	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.01
44	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
45	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
46	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00

47	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
48	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
49	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
50	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
51	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
52	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
53	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
54	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
55	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
56	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
57	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
58	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	600938	中国海油	13,277,048.00	0.66
1	00883	中国海洋石油	11,355,839.35	0.57
2	002371	北方华创	20,899,259.80	1.04
3	600188	兖矿能源	19,973,462.30	1.00
4	601088	中国神华	19,477,082.06	0.97
5	000983	山西焦煤	16,993,034.60	0.85
6	600256	广汇能源	16,987,397.70	0.85
7	600383	金地集团	16,435,197.00	0.82
8	002244	滨江集团	15,991,234.00	0.80
9	600703	三安光电	15,809,395.52	0.79
10	300083	创世纪	15,363,987.00	0.77
11	01024	快手-W	15,050,166.14	0.75
12	600808	马钢股份	12,991,997.13	0.65
13	601699	潞安环能	12,985,948.80	0.65
14	300280	紫天科技	12,895,290.00	0.64
15	601899	紫金矿业	12,086,496.56	0.60
16	002938	鹏鼎控股	10,993,820.70	0.55
17	002993	奥海科技	10,910,728.12	0.54
18	601666	平煤股份	9,991,680.96	0.50
19	002475	立讯精密	9,771,840.00	0.49
20	300529	健帆生物	9,391,527.99	0.47

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	300083	创世纪	47,111,232.00	2.35
2	600703	三安光电	25,298,845.92	1.26
3	600048	保利发展	23,408,837.68	1.17
4	000858	五粮液	22,811,076.28	1.14
5	603799	华友钴业	18,926,917.20	0.94
6	600383	金地集团	18,323,528.00	0.91
7	002371	北方华创	18,306,661.00	0.91
8	600570	恒生电子	15,736,722.50	0.79
9	300033	同花顺	13,215,592.00	0.66
10	01024	快手-W	13,142,243.51	0.66
11	002812	恩捷股份	12,568,840.00	0.63
12	601699	潞安环能	12,348,685.00	0.62
13	002475	立讯精密	10,491,551.00	0.52
14	300280	紫天科技	10,291,903.51	0.51
15	300580	贝斯特	10,159,596.00	0.51
16	600745	闻泰科技	9,465,868.00	0.47
17	688608	恒玄科技	9,317,551.50	0.46
18	300059	东方财富	8,915,783.00	0.44
19	600438	通威股份	8,870,127.27	0.44
20	603501	韦尔股份	8,821,581.00	0.44

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	668,623,189.37
卖出股票收入（成交）总额	633,594,080.46

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	290,177,445.74	17.35
	其中：政策性金融债	132,190,032.04	7.90
4	企业债券	506,476,258.23	30.29
5	企业短期融资券	150,496,620.01	9.00
6	中期票据	179,678,231.23	10.74
7	可转债（可交换债）	374,327,486.84	22.38

8	同业存单	59,086,036.92	3.53
9	其他	-	-
10	合计	1,560,242,078.97	93.30

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	220201	22 国开 01	900,000	90,951,928.77	5.44
2	155611	19 国宏 01	700,000	72,743,673.98	4.35
3	1928006	19 工商银行二级 01	700,000	72,642,517.26	4.34
4	1828006	18 中国银行二级 01	600,000	64,016,978.63	3.83
5	112281430	22 宁波银行 CD156	600,000	59,086,036.92	3.53

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，故此项目不适用。

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 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。

本基金本报告期末投资股指期货。

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 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

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	321,701.12
2	应收清算款	6,291,111.56
3	应收股利	914,752.16
4	应收利息	-
5	应收申购款	241,115.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,768,680.45

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	123125	元力转债	23,377,585.81	1.40
2	110045	海澜转债	19,649,465.75	1.18
3	132020	19 蓝星 EB	18,879,533.01	1.13
4	110075	南航转债	17,857,193.65	1.07
5	123099	普利转债	16,898,936.95	1.01
6	127033	中装转 2	16,067,715.56	0.96
7	123113	仙乐转债	15,990,343.04	0.96
8	110081	闻泰转债	15,309,317.73	0.92
9	123107	温氏转债	13,129,301.37	0.79
10	127044	蒙娜转债	11,204,423.99	0.67
11	128125	华阳转债	10,601,006.46	0.63
12	113046	金田转债	9,445,855.71	0.56
13	113049	长汽转债	9,201,388.77	0.55
14	123119	康泰转 2	8,888,198.77	0.53
15	110076	华海转债	7,973,987.67	0.48
16	110072	广汇转债	7,656,640.46	0.46
17	128044	岭南转债	7,537,097.26	0.45
18	113605	大参转债	7,322,669.37	0.44

19	128131	崇达转 2	6,867,346.57	0.41
20	127006	敖东转债	6,689,745.21	0.40
21	123128	首华转债	6,330,547.40	0.38
22	132015	18 中油 EB	5,239,513.70	0.31
23	127047	帝欧转债	4,647,475.05	0.28
24	123101	拓斯转债	4,481,353.42	0.27
25	128139	祥鑫转债	3,822,996.52	0.23
26	113050	南银转债	3,680,520.82	0.22
27	127051	博杰转债	3,151,579.48	0.19
28	128143	锋龙转债	3,140,423.97	0.19
29	127018	本钢转债	2,359,931.51	0.14
30	127048	中大转债	2,240,211.37	0.13
31	113579	健友转债	2,135,339.79	0.13
32	113619	世运转债	1,581,949.06	0.09
33	113637	华翔转债	1,425,874.52	0.09
34	128023	亚太转债	1,255,045.48	0.08

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	600938	中国海油	1,332,303.44	0.08	新股流通受限

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 (%)
兴全汇享一年持有混合 A	786,849	1,631.78	297,040.20	0.02	1,283,669,931.23	99.98
兴全汇享一年持有混合 C	9,343	24,380.57	33,383.12	0.01	227,754,243.29	99.99

合计	796,192	1,898.73	330,423.32	0.02	1,511,424,174.52	99.98
----	---------	----------	------------	------	------------------	-------

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	兴全汇享一年持有混合 A	292,201.02	0.0228
	兴全汇享一年持有混合 C	26,244.80	0.0115
	合计	318,445.82	0.0211

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴全汇享一年持有混合 A	0
	兴全汇享一年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全汇享一年持有混合 A	10~50
	兴全汇享一年持有混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全汇享一年持有混合 A	兴全汇享一年持有混合 C
基金合同生效日 (2020 年 7 月 8 日) 基金份额总额	4,125,674,756.88	159,727,919.38
本报告期期初基金份额总额	1,501,443,415.73	235,297,528.32
本报告期基金总申购份额	30,897,335.83	11,464,087.47
减：本报告期基金总赎回份额	248,373,780.13	18,973,989.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,283,966,971.43	227,787,626.41

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重大人事变动。

2022 年 1 月 21 日起，董承非先生离任公司副总经理；2022 年 1 月 28 日起，谢治宇先生任职公司副总经理；2022 年 6 月 30 日起，秦杰先生任职公司副总经理，郑文惠女士离任公司副总经理。

(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 (%)	
中信证券	2	443,955,426.15	34.92	281,633.78	34.05	-
兴业证券	3	170,210,000.84	13.39	125,342.82	15.15	-
华创证券	1	141,259,763.15	11.11	91,538.72	11.07	-

汇丰前海 证券	2	133,765,976. 19	10.52	84,436.43	10.21	-
招商证券	2	119,700,409. 25	9.42	75,569.40	9.14	-
浙商证券	2	108,293,977. 96	8.52	70,401.71	8.51	-
信达证券	2	73,467,965.8 4	5.78	46,378.87	5.61	-
华泰证券	2	38,884,321.8 1	3.06	24,547.06	2.97	-
中国中金 财富证券	2	36,894,382.3 4	2.90	24,205.11	2.93	-
光大证券	1	4,790,680.40	0.38	3,024.42	0.37	-
长江证券	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期权证 成交总额的 比例 (%)
中信证券	512,296,513. 05	45.31	2,857,472,000. 00	59.15	-	-
兴业证券	104,811,904. 18	9.27	269,503,000.00	5.58	-	-
华创证券	105,979,691. 19	9.37	50,399,000.00	1.04	-	-
汇丰前海 证券	112,242,569. 66	9.93	894,500,000.00	18.52	-	-
招商证券	48,583,008.2 7	4.30	94,500,000.00	1.96	-	-
浙商证券	98,293,557.3 2	8.69	162,000,000.00	3.35	-	-
信达证券	61,752,135.4 4	5.46	373,500,000.00	7.73	-	-
华泰证券	42,562,331.8 3	3.76	114,299,000.00	2.37	-	-
中国中金 财富证券	33,346,040.2 7	2.95	-	-	-	-
光大证券	10,812,464.7 4	0.96	15,000,000.00	0.31	-	-

长江证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

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	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-06
3	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-19
4	关于副总经理离任的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-21
5	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-26
6	关于公司副总经理任职的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-28
7	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-03-08
8	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-03-15
9	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-04-11
10	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-05-06
11	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-05-27
12	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、指定互联网网站	2022-06-17
13	关于公司副总经理变更的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

个人	-	-	-	-	-	-
产品特有风险						
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,故不涉及本项特有风险。						

注：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金每份基金份额的最短持有期为 1 年。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 1 年内无法赎回的风险。

2、根据《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22 号）等有关规定，兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下管理的公开募集证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具相关会计准则。执行新会计准则后，本公司旗下公开募集证券投资基金将按照新金融工具相关会计准则的规定进行会计计量。

§ 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享一年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴全汇享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享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

2022 年 8 月 31 日