

兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基 金中基金（FOF-LOF） 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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	6
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	10
§ 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§ 7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58

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	58
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	58
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12	本报告期投资基金情况	59
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	70
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2	期末上市基金前十名持有人	71
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 9	开放式基金份额变动	72
§ 10	重大事件揭示	73
10.1	基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4	基金投资策略的改变	73
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	73
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
10.9	其他重大事件	76
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 12	备查文件目录	78
12.1	备查文件目录	78
12.2	存放地点	78
12.3	查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）	
基金简称	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF	
场内简称	积极 FOF（扩位简称：积极配置 FOF）	
基金主代码	501215	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2021 年 11 月 12 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	4, 229, 539, 947. 58 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的 证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2021 年 11 月 19 日	
下属分级基金的基 金简称	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C
下属分级基金的场 内简称	积极 FOF（场内扩位简称：积极配置 FOF）	-
下属分级基金的交 易代码	501215	013786
报告期末下属分级 基金的份额总额	4, 022, 487, 863. 01 份	207, 052, 084. 57 份

注：基金合同生效后，前三年封闭运作，本基金的封闭期内投资人不能申购、赎回 A 类基金份额和 C 类基金份额，但可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让 A 类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金投资策略可细分为：大类资产配置策略、优选基金策略、股

	票投资策略、存托凭证的投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×85%+中债综合（全价）指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	胡波
	联系电话	021-20398888	021-61618888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95528
传真		021-20398858	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	上海市中山东一路 12 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼	上海市北京东路 689 号
邮政编码		201204	200001
法定代表人		杨华辉	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 份额：中国证券登记结算有限责任公司 C 份额：兴证全球基金管理有限公司	A 份额：北京市西城区太平桥大街 17 号 C 份额：上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-29 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)	
	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C
本期已实现收益	11,883,627.32	331,194.34

本期利润	-295,709,524.74	-15,504,441.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0735	-0.0749
本期加权平均净值利润率	-8.08%	-8.24%
本期基金份额净值增长率	-7.25%	-7.38%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-241,645,258.79	-12,806,026.82
期末可供分配基金份额利润	-0.0601	-0.0618
期末基金资产净值	3,780,842,604.22	194,246,057.75
期末基金份额净值	0.9399	0.9382
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	-6.01%	-6.18%

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

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A

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

	率①	准差②		④		
过去一个月	7.07%	0.87%	9.03%	1.01%	-1.96%	-0.14%
过去三个月	5.03%	1.20%	7.76%	1.30%	-2.73%	-0.10%
过去六个月	-7.25%	1.18%	-8.37%	1.29%	1.12%	-0.11%
自基金合同生效起 至今	-6.01%	1.05%	-8.56%	1.18%	2.55%	-0.13%

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF 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	7.05%	0.87%	9.03%	1.01%	-1.98%	-0.14%
过去三个月	4.97%	1.20%	7.76%	1.30%	-2.79%	-0.10%
过去六个月	-7.38%	1.18%	-8.37%	1.29%	0.99%	-0.11%
自基金合同生效起 至今	-6.18%	1.05%	-8.56%	1.18%	2.38%	-0.13%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×85%+中债综合（全价）指数收益率×15%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金，且原则上会以85%的基金资产投资于权益类资产，因此本基金业绩比较基准中的85%选择了中证偏股型基金指数收益率。中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券投资业绩的比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 85\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率}_t / \text{中证偏股型基金指数收益率}_{t-1})$$

-1) +15%×(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)

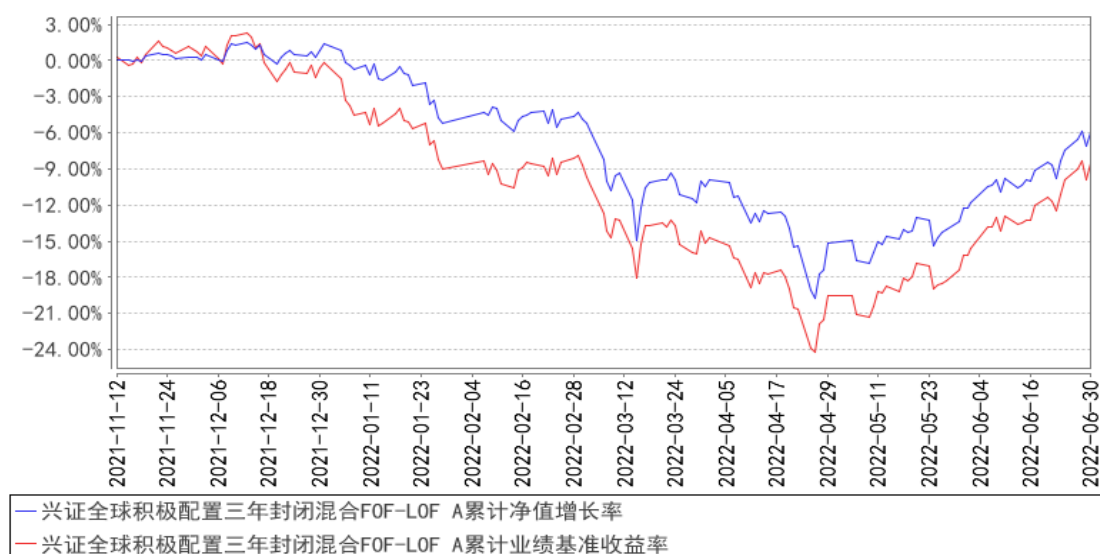
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

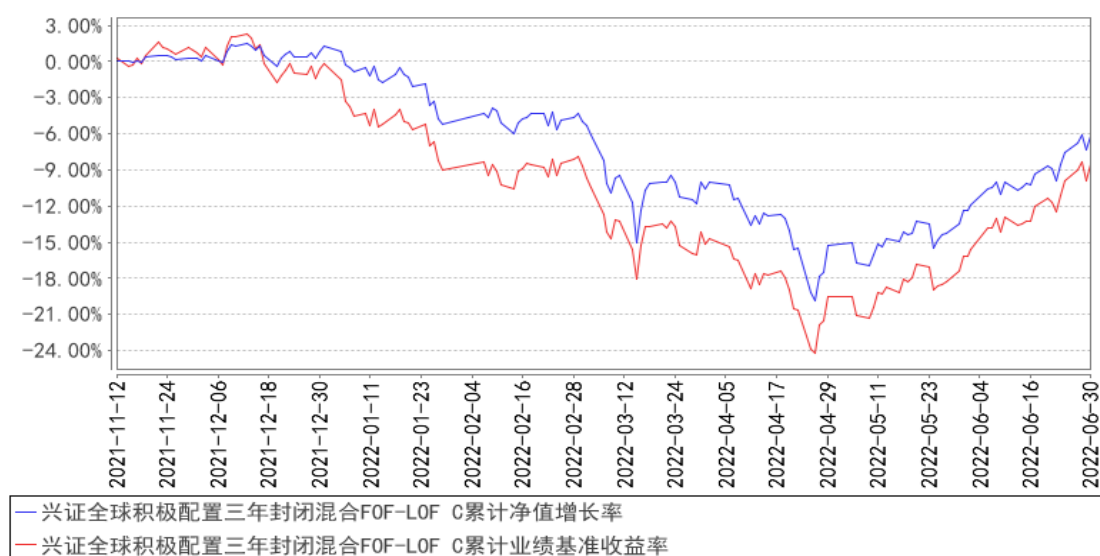
2、本基金成立于 2021 年 11 月 12 日, 截至 2022 年 6 月 30 日, 本基金成立不满一年。

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

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF 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



兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF 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《兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2021 年 11 月 12 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本

基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3、本基金成立于 2021 年 11 月 12 日，截至 2022 年 6 月 30 日，本基金成立不满一年。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 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		
林国怀	FOF 投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年持	2021 年 11 月 12 日	-	15 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。

	<p>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基金（FOF）、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴证全球积极配置三年封闭运作混合型中</p>				
--	---	--	--	--	--

	基金 (FOF-LOF)、兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金 (FOF) 基金经理				
丁凯琳	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金 (FOF-LOF) 基金经理	2021 年 11 月 12 日	-	9 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、本基金基金经理丁凯琳女士，自 2022 年 5 月 5 日起开始休产假，期间由林国怀先生单独管理本基金。

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、《兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）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 年上半年股票市场在快速下跌后 V 型反弹，1-4 月份相对热门的“新半军”板块出现了较大幅度的调整，5、6 月份前期跌幅相对较大的行业和板块又出现快速上涨，尤其是以新能源、汽车、军工等行业涨幅领先。从整个上半年来看，沪深 300 指数下跌 9.22% 上证 50 指数下跌 6.59%，中证 500 和中证 1000 指数分别下跌 12.30% 和 12.67%，创业板 50 下跌 15.41%；以高股息股票为主要标的的上证红利和中证红利指数表现相对较好，涨跌幅分别为 3.09% 和 -1.99%。从行业表现上来看，煤炭行业一枝独秀，上半年涨幅 31.38%，交通运输、综合、美容护理、房地产、有色、银行等行业跌幅相对较小，而电子、计算机、传媒、军工行业半年跌幅在 20% 以上；从风格指数上来看，低市盈率指数表现优于中、高市盈率指数，大盘指数表现优于中、小盘指数。有一个值得注意的现象是，自 4 月 27 日市场反弹以来，中、高市盈率指数表现大幅优于低市盈率指数，行业上分化也是非常明显，银行、地产涨幅不足 5%，而电力设备、汽车的区间涨幅在 50% 附近。

债券市场方面，上半年债市总体呈现震荡走势，十年国债收益率在 2.70-2.85 的狭窄区间内

震荡。同时，疫情背景下央行维持宽松货币政策，收益率曲线呈陡峭化态势，短端收益率下行明显，1 年期国债收益率由 2.24 下降到 1.95。信用债走势整体强于利率债，中低资质信用债收益率下行更多，信用利差已被压缩至历史极低位置。

上半年，中证偏股基金指数下跌 10.02%，中长期纯债基金指数上涨 1.41%，标普 500ETF 下跌 16.43%，黄金 ETF 上涨 4.49%。

资产配置层面，本基金坚持 85%的权益类资产和 15%的固定收益类资产的战略资产配置；在战术资产配置上，考虑到产品的风险定位偏高风险定位，4 月下旬以后随着市场逐步进入相对低估区间，本基金继续逢低增加权益配置比例。

品种选择层面，本基金的基金选择思路更侧重于从基金经理的投资风格和盈利模式角度出发，所以更加倾向于对风格稳定的基金经理长期持有。目前组合在风格配置上，以追求安全边际的价值型基金和追求性价比的 GARP 型基金配置为主，场内封闭式基金随着开放赎回进行逐步减持；同时，4 月份以后积极参与股票定增和大宗交易，通过有折价的方式参与部分成长股的投资。

上半年整体组合跑赢业绩比较基准，组合的波动率、最大回撤方面整体控制依然相对良好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A 的基金份额净值为 0.9399 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.25%，同期业绩比较基准收益率为-8.37%；截至本报告期末兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C 的基金份额净值为 0.9382 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.38%，同期业绩比较基准收益率为-8.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内、外宏观形势均处于比较复杂的阶段，海外通胀水平维持高位，俄乌战争仍在继续，IMF 不断下调全球的经济预期，美国市场预期未来经济衰退的概率上升。国内的经济数据在货币宽松、财政发力的政策作用下逐步从四、五月份的疫情中逐步复苏，但后续的经济增长情况仍需进一步的观察。

自 2019 年以来的市场大幅上涨，市场分化尤为显著，资金对于成长性的追逐已处于一个相对“白热化”阶段，2019、2020 年对于盈利质量的长期成长逻辑的过分追捧，2021 年以及今年 4 月底反弹以来对于短期景气度的高度关注，说明当前市场在存量资金博弈的过程中，相对看重短期的景气数据，而对于安全边际、长期配置方面的考量相对较少，从而可能会导致股票市场出现较大幅度的波动和快速轮动。

基于中长期的角度来看，我们依然看好 A 股市场的长期震荡上行的方向，但从中短期而言，目前新增资金相对缺乏，在存量资金博弈的背景下，我们更加倾向于重视“安全边际”和“性价

比”，对于高估值的领域和板块保持适度谨慎，同时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相对收益或绝对收益的投资机会。此外，我们将继续按照“多资产、多策略”的方式来构建组合，随着海外市场的大幅下跌，也将逢低增加海外 QDII 基金的配置比例，从而增加组合的收益来源，进一步平滑未来的组合的业绩波动率。

本基金是一只集中配置于权益类资产的普通 FOF 产品，目前仍处于封闭期，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，兼顾长期收益率和改善持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值。

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》、《兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由兴证全球基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

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	75,298,395.33	96,834,075.15
结算备付金		210,850.53	68,860,165.96
存出保证金		163,615.53	55,289.90
交易性金融资产	6.4.7.2	3,873,417,386.82	3,723,218,511.86
其中：股票投资		165,960,122.28	191,433,113.14
基金投资		3,705,810,376.11	3,531,785,398.72
债券投资		1,646,888.43	-
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	-	400,000,000.00
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		29,625,012.11	1,297,399.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	1,327.69	-110,741.71
资产总计		3,978,716,588.01	4,290,154,700.25
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	7.07
应付管理人报酬		2,970,523.87	3,137,597.48
应付托管费		465,766.10	534,855.39
应付销售服务费		46,064.98	53,075.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7.30	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	145,563.79	126,533.84
负债合计		3,627,926.04	3,852,069.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,229,539,947.58	4,229,539,949.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-254,451,285.61	56,762,680.86
净资产合计		3,975,088,661.97	4,286,302,630.83
负债和净资产总计		3,978,716,588.01	4,290,154,700.25

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A 基金份额净值 0.9399 元，基金份额总额 4,022,487,863.01 份；兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C 基金份额净值 0.9382 元，基金份额总额 207,052,084.57 份。兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF 份额总额合计为 4,229,539,947.58 份。

2、本基金合同生效日为 2021 年 11 月 12 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 11 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

3、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：兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-290,670,059.39
1. 利息收入		545,245.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	228,926.79
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		316,318.37
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		32,197,402.14
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-9,134,361.39
基金投资收益	6.4.7.15	-10,797,854.22
债券投资收益	6.4.7.16	265,917.08
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	51,863,700.67
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-323,428,788.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	16,081.43
减：二、营业总支出		20,543,907.07
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,337,461.14

2. 托管费	6.4.10.2.2	2,821,812.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	280,320.90
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		0.79
8. 其他费用	6.4.7.24	104,311.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-311,213,966.46
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-311,213,966.46
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-311,213,966.46

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：兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）

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)	4,229,539,949.97	-	56,762,680.86	4,286,302,630.83
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)	4,229,539,949.97	-	56,762,680.86	4,286,302,630.83
三、本期	-2.39	-	-311,213,966.47	-311,213,968.86

增减变动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-311,213,966.46	-311,213,966.46
(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)	-2.39	-	-0.01	-2.40
其中:1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-2.39	-	-0.01	-2.40
(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)	4,229,539,947.58	-	-254,451,285.61	3,975,088,661.97

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

兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）（以下简称“本基金”），系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]3048 号文的核准予以公开募集，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集基金份额为 4,229,540,024.34 份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（21）第 00559 号验资报告。基金合同于 2021 年 11 月 12 日正式生效，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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（包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、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的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×85%+中债综合（全价）指数收益率×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称

“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

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附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日和 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 11 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 11 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间和 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

自 2021 年 11 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间：

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

自 2022 年 1 月 1 日起：

(a) 金融资产的分类

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

本基金持有的股票投资、基金投资及债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

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

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本基金可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

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

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

(b) 金融负债的分类

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

自 2021 年 11 月 12 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间：

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

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

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 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公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

自 2022 年 1 月 1 日起：

(a) 金融工具的初始确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于

其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算

的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 封闭期间，基金收益分配采用现金分红方式；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金

红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在上海证券账户的基金份额只能采取现金分红方式，不能选择红利再投资；具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

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

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供

的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年度起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《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〉》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（以下统称“新金融工具准则”）相关衔接规定，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》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的商业模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初

留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对 2022 年 1 月 1 日本基金资产负债表各项目的影​​响汇总如下：

金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息，对应的账面价值分别为人民币 96,834,075.15 元、68,860,165.96 元、55,289.90 元、400,000,000.00 元、-115,846.55 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产，对应的账面价值分别为人民币 96,854,573.28 元、68,894,251.77 元、55,317.29 元、399,829,542.12 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为应付交易费用、其他负债，对应的账面价值分别为人民币 106,533.84 元、20,000.00 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以摊余成本计量的金融负债为其他负债，对应的账面价值为人民币 126,533.84 元。

(b) 修订的《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>》

本基金根据修订的《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>》编制财务报表时，调整了部分财务报表科目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、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》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易

印花税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《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》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代

缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	75,298,395.33
等于：本金	75,290,612.11
加：应计利息	7,783.22
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	75,298,395.33
----	---------------

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	175,814,294.01	-	165,960,122.28	-9,854,171.73	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,507,730.30	824.83	1,646,888.43	138,333.30
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,507,730.30	824.83	1,646,888.43	138,333.30
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	3,961,667,826.27	-	3,705,810,376.11	-255,857,450.16	
其他	-	-	-	-	
合计	4,138,989,850.58	824.83	3,873,417,386.82	-265,573,288.59	

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：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

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。

6.4.7.4.3 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	1,327.69
待摊费用	-
合计	1,327.69

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	36,303.64

其中：交易所市场	36,303.64
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	79,507.37
预提审计费用	29,752.78
合计	145,563.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF 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	4,022,487,865.40	4,022,487,865.40
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2.39	-2.39
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	4,022,487,863.01	4,022,487,863.01

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF 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	207,052,084.57	207,052,084.57
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	207,052,084.57	207,052,084.57

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

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

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期期初	-959,659.70	55,023,925.66	54,064,265.96
本期利润	11,883,627.32	-307,593,152.06	-295,709,524.74
本期基金份额交易产生的变动数	-	-0.01	-0.01
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-0.01	-0.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,923,967.62	-252,569,226.41	-241,645,258.79

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-133,158.62	2,831,573.52	2,698,414.90
本期利润	331,194.34	-15,835,636.06	-15,504,441.72
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	198,035.72	-13,004,062.54	-12,806,026.82

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	120,578.35
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	106,970.07
其他	1,378.37
合计	228,926.79

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	-9,134,361.39
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-9,134,361.39

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	45,731,463.59
减：卖出股票成本总额	54,754,278.73
减：交易费用	111,546.25
买卖股票差价收入	-9,134,361.39

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	638,363,278.41
减：卖出/赎回基金成本总额	648,950,664.82
减：买卖基金差价收入应缴纳增值 税额	-
减：交易费用	210,467.81
基金投资收益	-10,797,854.22

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	219.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券 到期兑付）差价收入	265,697.37
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	265,917.08

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	2,465,765.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 本总额	2,200,000.00
减：应计利息总额	64.89
减：交易费用	2.81

买卖债券差价收入	265,697.37
----------	------------

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.20 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	1,067,293.37
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	50,796,407.30
合计	51,863,700.67

6.4.7.21 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	-323,428,788.12
股票投资	-17,229,862.31
债券投资	138,333.30
资产支持证券投资	-
基金投资	-306,337,259.11
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	-323,428,788.12

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	16,081.43
合计	16,081.43

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	143,024.97
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	21,144,613.67
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,563,976.69

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 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	-
账户维护费	4,500.00
银行费用	10,551.50
合计	104,311.65

6.4.7.26 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

截至财务报表批准日，本基金无须做披露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
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东

上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人、基金销售机构
------------------------	--------------

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	62,991,727.49	78.98

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

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	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
兴业证券	119,688,642.77	32.73

6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	39,911.45	78.89	31,618.68	87.10

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,337,461.14
其中：支付销售机构的客户维护费	8,441,964.85

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.1% 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×1.1%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,821,812.59

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。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×0.15%/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		
	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C	合计
浦发银行	-	110,729.25	110,729.25
兴业证券	-	44,247.54	44,247.54
兴证全球基金	-	784.91	784.91
合计	-	155,761.70	155,761.70

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C 日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.3%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

注：本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期末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。

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：无。

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：无。

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	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	75,298,395.33	120,578.35

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计算。

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：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**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554,322,711.43元，占本基金资产净值的比例为13.94%。

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 2022年1月1日至2022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）	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	15,961.84

当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,848,154.66
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	498,634.75

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：本基金本报告期末未进行利润分配。

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
300383	光环新网	2021年12月29日	6个月	非公开发行流通受限	11.79	10.42	1,017,812	12,000,003.48	10,605,601.04	-
300769	德方纳米	2022年5月17日	6个月	大宗交易购入流通受限	246.95	372.35	40,000	9,878,000.00	14,894,000.00	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-
301103	何氏眼科	2022年6月1日	3-4个月	新股流通受限-转增	-	32.02	117	-	3,746.34	-
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	-
301200	大族数控	2022年2月	6个月	新股流通	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-

		18日		受限						
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	-
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	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
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	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
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	-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
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	-
688083	中望软件	2022年6月17日	6个月	询价转让流通受限	168.01	190.42	37,128	6,237,875.28	7,069,913.76	-
688270	臻镭科技	2022年1月20日	6个月	新股流通受限	61.88	59.87	3,705	229,265.40	221,818.35	-
688663	新风光	2022年6月9日	6个月	大宗交易购入	29.00	30.34	230,000	6,670,000.00	6,978,200.00	-

				流通受限						
--	--	--	--	------	--	--	--	--	--	--

注：本基金持有的新股流通受限股票何氏眼科，于 2022 年 6 月 1 日实施 2021 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 6 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股。本基金新增 117 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

注：本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%，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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	1,646,888.43	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,646,888.43	-

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

本基金合同生效后三年之内（含三年）为封闭期，在此期间投资者不能申购、赎回基金份额。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、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	75,298,395.33	-	-	-	-	-	75,298,395.33
结算备付金	210,850.53	-	-	-	-	-	210,850.53
存出保证金	163,615.53	-	-	-	-	-	163,615.53
交易性金融资产	-	-	-	1,646,888.43	-	3,871,770,498.39	3,873,417,386.82
应收清算款	-	-	-	-	-	29,625,012.11	29,625,012.11
其他资产	-	-	-	-	-	1,327.69	1,327.69
资产总计	75,672,861.39	-	-	1,646,888.43	-	3,901,396,838.19	3,978,716,588.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,970,523.87	2,970,523.87
应付托管费	-	-	-	-	-	465,766.10	465,766.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	46,064.98	46,064.98
应交税费	-	-	-	-	-	7.30	7.30
其他负债	-	-	-	-	-	145,563.79	145,563.79

负债总计	-	-	-	-	-	3,627,926.04	3,627,926.04
利率敏感度缺口	75,672,861.39	-	-	1,646,888.43	-	3,897,768,912.15	3,975,088,661.97
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	96,834,075.15	-	-	-	-	-	96,834,075.15
结算备付金	68,860,165.96	-	-	-	-	-	68,860,165.96
存出保证金	55,289.90	-	-	-	-	-	55,289.90
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,723,218,511.86	3,723,218,511.86
买入返售金融资产	400,000,000.00	-	-	-	-	-	400,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,297,399.09	1,297,399.09
其他资产	-	-	-	-	-	-110,741.71	-110,741.71
资产总计	565,749,531.01	-	-	-	-	3,724,405,169.24	4,290,154,700.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	7.07	7.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,137,597.48	3,137,597.48
应付托管费	-	-	-	-	-	534,855.39	534,855.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	53,075.64	53,075.64
其他负债	-	-	-	-	-	126,533.84	126,533.84
负债总计	-	-	-	-	-	3,852,069.42	3,852,069.42
利率敏感度缺口	565,749,531.01	-	-	-	-	3,720,553,099.82	4,286,302,630.83

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

注：无。

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的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于权益类资产（股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 85%，投资比例范围为基金资产的 60%–95%；本基金封闭期届满转换为开放式基金的前后各 3 个月内，不受前述投资组合比例的限制。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	165,960,122.28	4.18	191,433,113.14	4.47
交易性金融资产—基金投资	3,705,810,376.11	93.23	3,531,785,398.72	82.40
交易性金融资产—债券投资	1,646,888.43	0.04	—	—
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	3,873,417,386.82	97.44	3,723,218,511.86	86.86

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 10%	373,207,873.20	-
	业绩比较基准下降 10%	-373,207,873.20	-

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

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,830,476,991.70	3,655,133,658.48
第二层次	1,530,550.70	-
第三层次	41,409,844.42	68,084,853.38
合计	3,873,417,386.82	3,723,218,511.86

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可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	165,960,122.28	4.17
	其中：股票	165,960,122.28	4.17
2	基金投资	3,705,810,376.11	93.14
3	固定收益投资	1,646,888.43	0.04
	其中：债券	1,646,888.43	0.04
	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	75,509,245.86	1.90
8	其他各项资产	29,789,955.33	0.75
9	合计	3,978,716,588.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,830,632.44	0.12
C	制造业	109,206,471.44	2.75
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	1,405,744.00	0.04
H	住宿和餐饮业	2,553,740.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,351,077.80	0.74
J	金融业	4,814,087.96	0.12
K	房地产业	5,135,714.00	0.13
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	5,925,073.17	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	680,608.69	0.02
R	文化、体育和娱乐业	2,037,013.00	0.05
S	综合	-	-
	合计	165,960,122.28	4.18

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	300769	德方纳米	40,000	14,894,000.00	0.37
2	300383	光环新网	1,017,812	10,605,601.04	0.27
3	688083	中望软件	37,128	7,069,913.76	0.18
4	688663	新风光	230,000	6,978,200.00	0.18
5	000858	五粮液	19,900	4,018,407.00	0.10
6	002390	信邦制药	460,000	3,178,600.00	0.08
7	000568	泸州老窖	12,800	3,155,712.00	0.08
8	603259	药明康德	29,000	3,015,710.00	0.08
9	300760	迈瑞医疗	9,400	2,944,080.00	0.07
10	002250	联化科技	179,700	2,941,689.00	0.07
11	300416	苏试试验	117,130	2,879,055.40	0.07
12	002493	荣盛石化	181,000	2,785,590.00	0.07

13	603799	华友钴业	28,600	2,734,732.00	0.07
14	300633	开立医疗	89,300	2,681,679.00	0.07
15	600309	万华化学	27,400	2,657,526.00	0.07
16	600048	保利发展	150,900	2,634,714.00	0.07
17	002920	德赛西威	17,400	2,575,200.00	0.06
18	600754	锦江酒店	40,600	2,553,740.00	0.06
19	000002	万科 A	122,000	2,501,000.00	0.06
20	603517	绝味食品	40,600	2,347,492.00	0.06
21	601899	紫金矿业	249,300	2,325,969.00	0.06
22	300454	深信服	22,400	2,324,672.00	0.06
23	600315	上海家化	53,500	2,287,125.00	0.06
24	688005	容百科技	17,200	2,226,368.00	0.06
25	002415	海康威视	61,100	2,211,820.00	0.06
26	600521	华海药业	94,500	2,145,150.00	0.05
27	300482	万孚生物	51,700	2,104,707.00	0.05
28	000001	平安银行	140,102	2,098,727.96	0.05
29	002568	百润股份	65,380	1,964,015.20	0.05
30	002555	三七互娱	92,500	1,963,775.00	0.05
31	600460	士兰微	37,700	1,960,400.00	0.05
32	600760	中航沈飞	31,700	1,916,265.00	0.05
33	600690	海尔智家	69,200	1,900,232.00	0.05
34	600519	贵州茅台	900	1,840,500.00	0.05
35	002508	老板电器	50,700	1,826,721.00	0.05
36	603816	顾家家居	32,240	1,825,751.20	0.05
37	600862	中航高科	64,100	1,801,210.00	0.05
38	600885	宏发股份	42,980	1,798,713.00	0.05
39	600161	天坛生物	71,700	1,740,876.00	0.04
40	600570	恒生电子	39,600	1,724,184.00	0.04
41	688099	晶晨股份	16,800	1,696,800.00	0.04
42	300188	美亚柏科	123,900	1,670,172.00	0.04
43	600150	中国船舶	85,700	1,626,586.00	0.04
44	603707	健友股份	55,800	1,573,560.00	0.04
45	600703	三安光电	63,800	1,568,204.00	0.04
46	600745	闻泰科技	17,800	1,514,958.00	0.04
47	600406	国电南瑞	56,040	1,513,080.00	0.04
48	600809	山西汾酒	4,600	1,494,080.00	0.04
49	002036	联创电子	97,100	1,491,456.00	0.04
50	000739	普洛药业	71,900	1,484,016.00	0.04
51	300207	欣旺达	46,500	1,469,400.00	0.04
52	600036	招商银行	34,700	1,464,340.00	0.04
53	300327	中颖电子	29,260	1,457,440.60	0.04
54	600882	妙可蓝多	31,000	1,450,800.00	0.04

55	002064	华峰化学	167,300	1,412,012.00	0.04
56	002120	韵达股份	82,400	1,405,744.00	0.04
57	600660	福耀玻璃	33,100	1,383,911.00	0.03
58	300144	宋城演艺	87,500	1,343,125.00	0.03
59	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.03
60	300476	胜宏科技	71,400	1,310,904.00	0.03
61	603486	科沃斯	10,500	1,279,845.00	0.03
62	300638	广和通	47,550	1,259,599.50	0.03
63	601688	华泰证券	88,100	1,251,020.00	0.03
64	601857	中国石油	221,200	1,172,360.00	0.03
65	002182	云海金属	44,200	1,108,536.00	0.03
66	300316	晶盛机电	15,500	1,047,645.00	0.03
67	601633	长城汽车	27,700	1,026,008.00	0.03
68	300496	中科创达	6,000	782,880.00	0.02
69	300413	芒果超媒	20,800	693,888.00	0.02
70	600763	通策医疗	2,700	470,988.00	0.01
71	600580	卧龙电驱	15,800	227,836.00	0.01
72	688270	臻镭科技	3,705	221,818.35	0.01
73	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
74	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
75	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
76	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
77	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
78	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
79	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
80	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
81	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
82	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
83	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
84	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
85	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
86	301181	标榜股份	257	7,861.63	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	300769	德方纳米	9,878,000.00	0.23
2	688663	新风光	6,670,000.00	0.16
3	688083	中望软件	6,237,875.28	0.15
4	603707	健友股份	1,693,473.00	0.04
5	002568	百润股份	1,686,725.00	0.04

6	300454	深信服	1,566,217.00	0.04
7	000002	万科A	1,297,754.00	0.03
8	600938	中国海油	1,296,054.00	0.03
9	300638	广和通	1,215,450.00	0.03
10	688223	晶科能源	1,065,000.00	0.02
11	600703	三安光电	1,042,765.00	0.02
12	002508	老板电器	994,354.00	0.02
13	600690	海尔智家	946,619.00	0.02
14	600036	招商银行	890,957.00	0.02
15	000739	普洛药业	697,884.00	0.02
16	300496	中科创达	686,794.00	0.02
17	301238	瑞泰新材	670,647.88	0.02
18	301200	大族数控	655,812.96	0.02
19	002064	华峰化学	597,956.00	0.01
20	002493	荣盛石化	499,508.00	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	300793	佳禾智能	11,735,591.15	0.27
2	002938	鹏鼎控股	8,308,515.00	0.19
3	002607	中公教育	6,928,422.00	0.16
4	300451	创业慧康	6,920,925.60	0.16
5	002851	麦格米特	4,805,784.00	0.11
6	688223	晶科能源	2,220,238.64	0.05
7	301238	瑞泰新材	1,054,856.56	0.02
8	600938	中国海油	580,160.11	0.01
9	301200	大族数控	523,852.10	0.01
10	301215	中汽股份	427,655.00	0.01
11	301207	华兰疫苗	385,840.30	0.01
12	688306	均普智能	304,652.98	0.01
13	301256	华融化学	257,456.97	0.01
14	301102	兆讯传媒	201,584.00	0.00
15	301286	侨源股份	193,102.00	0.00
16	301103	何氏眼科	169,913.80	0.00
17	688267	中触媒	151,983.35	0.00
18	301237	和顺科技	121,946.45	0.00
19	301181	标榜股份	109,579.28	0.00
20	688283	坤恒顺维	60,625.95	0.00

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	46,511,150.18
卖出股票收入（成交）总额	45,731,463.59

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	1,646,888.43	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,646,888.43	0.04

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	132026	G 三峡 EB2	11,350	1,271,728.63	0.03
2	113044	大秦转债	3,440	375,159.80	0.01

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：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此不适用于。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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

本基金为基金中基金，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。本基金主要投资于公开募集证券投资基金，且资产比例不低于基金资产的 80%，其中，投资于权益类资产（股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 85%，投资比例范围为基金资产的 60%-95%；本基金封闭期届满转换为开放式基金的前后各 3 个月内，不受前述投资组合比例的限制。本基金整体风险中等，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	001821	兴全天添益货币 B	契约型开放式	161,692,436.62	161,692,436.62	4.07	是
2	006567	中泰星元灵活配置混合 A	契约型开放式	58,734,079.53	146,012,921.71	3.67	否
3	100032	富国中证红利指数增强 A	契约型开放式	129,483,396.91	137,770,334.31	3.47	否
4	000251	工银金融地产混合 A	契约型开放式	49,487,631.47	130,597,859.45	3.29	否

5	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	47,971,490.68	125,109,647.69	3.15	否
6	004958	圆信永丰优享生活混合	契约型开放式	49,001,350.73	107,837,272.55	2.71	否
7	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	29,902,062.52	106,541,048.76	2.68	否
8	513500	博时标普 500ETF(QDII)	交易型开放式 (ETF)	83,137,798.00	99,349,668.61	2.50	否
9	166001	中欧新趋势混合 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	67,798,333.32	98,273,684.15	2.47	否
10	003293	易方达科瑞灵活配置混合	契约型开放式	46,566,730.67	96,923,993.22	2.44	否
11	750001	安信灵活配置混合	契约型开放式	35,766,344.23	93,672,055.54	2.36	否
12	002076	浙商中证 500 指数增强 A	契约型开放式	55,550,512.20	91,752,781.00	2.31	否
13	166019	中欧价值智选混合 A	契约型开放式	18,536,360.31	89,988,468.40	2.26	否
14	519156	新华行业灵活配置混合 A	契约型开放式	41,932,366.73	89,332,714.08	2.25	否
15	512160	MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易型开放式	52,924,100.00	84,361,015.40	2.12	否

			(ETF)				
16	163417	兴全合宜混合 (LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	48,103,854.33	82,055,554.72	2.06	是
17	008269	大成睿享混合 A	契约 型开 放式	63,840,524.90	78,977,113.35	1.99	否
18	000471	富国城镇发展 股票	契约 型开 放式	30,874,709.37	76,970,650.46	1.94	否
19	519773	交银数据产业 灵活配置混合	契约 型开 放式	36,805,282.36	75,815,201.13	1.91	否
20	163412	兴全轻资产混 合(LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	21,101,102.11	69,633,636.96	1.75	是
21	001409	工银互联网加 股票	契约 型开 放式	110,870,500.75	69,626,674.47	1.75	否
22	340006	兴全全球视野 股票	契约 型开 放式	21,698,015.59	62,097,550.82	1.56	是
23	005001	交银持续成长 主题混合	契约 型开 放式	26,638,571.40	61,020,975.51	1.54	否
24	161039	富国中证 1000 指数增 强(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	28,717,937.92	57,814,952.62	1.45	否
25	007549	中泰开阳价值 优选混合 A	契约 型开	25,768,396.11	57,716,053.61	1.45	否

			放式				
26	519915	富国消费主题混合 A	契约型开放式	19,479,710.14	57,445,665.20	1.45	否
27	166009	中欧新动力混合 (LOF)A	上市契约型开放式 (LOF)	16,219,651.63	56,230,288.27	1.41	否
28	270025	广发行业领先混合 A	契约型开放式	30,025,077.51	56,116,869.87	1.41	否
29	007493	朱雀产业臻选混合 A	契约型开放式	27,911,996.80	52,047,500.43	1.31	否
30	110023	易方达医疗保健行业混合	契约型开放式	16,167,974.14	49,344,657.08	1.24	否
31	009837	华夏磐锐一年定开混合 A	契约型开放式	38,704,907.88	48,106,330.00	1.21	否
32	000778	鹏华先进制造股票	契约型开放式	15,136,618.73	47,407,889.86	1.19	否
33	007806	建信 MSCI 中国 A 股指数增强 A	契约型开放式	31,913,178.85	47,308,096.33	1.19	否
34	007449	兴全多维价值混合 A	契约型开放式	24,397,692.16	46,192,150.57	1.16	是
35	510900	易方达恒生国企 (QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	49,350,800.00	42,737,792.80	1.08	否
36	690005	民生加银内需增长混合	契约型开	19,075,878.72	42,615,513.06	1.07	否

			放式				
37	512800	华宝中证银行ETF	交易型开放式(ETF)	35,679,700.00	40,710,537.70	1.02	否
38	159920	恒生ETF	交易型开放式(ETF)	32,687,249.00	38,734,390.07	0.97	否
39	310398	申万菱信沪深300价值指数A	契约型开放式	29,787,197.63	37,954,847.22	0.95	否
40	002980	华夏创新前沿股票	契约型开放式	13,968,436.02	34,055,047.02	0.86	否
41	001112	东方红中国优势混合	契约型开放式	15,649,283.01	33,552,062.77	0.84	否
42	487021	工银优质精选混合	契约型开放式	8,931,295.10	32,224,112.72	0.81	否
43	610005	信达澳银红利回报混合	契约型开放式	22,115,599.79	28,374,314.53	0.71	否
44	008657	景顺长城科技创新混合	契约型开放式	18,570,632.66	26,784,423.49	0.67	否
45	163409	兴全绿色投资混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	12,949,152.00	26,701,151.42	0.67	是
46	550016	信诚至远混合C	契约型开放式	6,856,359.27	25,579,705.16	0.64	否

47	006039	国富估值优势混合	契约型开放式	11,334,920.28	25,570,446.66	0.64	否
48	000020	景顺长城品质投资混合	契约型开放式	6,963,556.17	25,152,364.89	0.63	否
49	163417	兴全合宜	上市契约型开放式(LOF)	13,700,281.00	23,057,572.92	0.58	是
50	100038	富国沪深300增强A	契约型开放式	11,800,463.45	20,343,998.99	0.51	否
51	008763	天弘越南市场股票(QDII)A	契约型开放式	15,271,383.27	20,138,373.12	0.51	否
52	002462	中银珍利混合C	契约型开放式	16,625,103.91	20,133,000.84	0.51	否
53	163415	兴全商业模式优选混合(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	5,913,306.00	19,916,014.61	0.50	是
54	512170	华宝中证医疗ETF	交易型开放式(ETF)	34,028,000.00	19,736,240.00	0.50	否
55	002262	中银宝利混合C	契约型开放式	18,018,018.02	19,639,639.64	0.49	否
56	005775	中加转型动力混合A	契约型开放式	7,823,497.89	19,590,038.72	0.49	否
57	005354	富国沪港深行	契约	13,793,365.06	18,652,767.57	0.47	否

		业精选灵活配置混合型发起式 A	型开放式				
58	163415	兴全模式	上市契约型开放式 (LOF)	5,311,252.00	17,734,270.43	0.45	是
59	340007	兴全社会责任混合	契约型开放式	3,349,522.69	17,102,662.86	0.43	是
60	340008	兴全有机增长混合	契约型开放式	4,403,249.59	17,018,559.67	0.43	是
61	008284	易方达全球医药行业混合发起式 (QDII) (人民币份额)	契约型开放式	18,930,358.52	16,759,046.40	0.42	否
62	512720	国泰中证计算机主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	13,787,400.00	15,014,478.60	0.38	否
63	005613	上投摩根富时发达市场 REITs 指数 (QDII)	契约型开放式	12,460,930.94	14,651,562.60	0.37	否
64	162720	创业广发	上市契约型开放式 (LOF)	13,508,501.00	14,440,587.57	0.36	否
65	501202	华泰紫金科创 3 年封闭混合 C	契约型开放式	12,243,211.00	13,247,154.30	0.33	否
66	501079	大成科创主题 3 年封闭混合	契约型开	5,903,030.00	12,927,635.70	0.33	否

			放式				
67	006002	工银医药健康股票 A	契约型开放式	4,499,190.06	11,542,672.10	0.29	否
68	160926	创业大成	上市契约型开放式 (LOF)	8,845,364.00	10,915,179.18	0.27	否
69	008682	富国中证红利指数增强 C	契约型开放式	9,556,537.55	10,091,703.65	0.25	否
70	160529	创业博时	上市契约型开放式 (LOF)	6,869,755.00	7,845,260.21	0.20	否
71	501095	中银证券科技创新 3 年封闭混合	契约型开放式	7,343,338.00	7,468,174.75	0.19	否
72	512990	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,125,500.00	7,087,609.00	0.18	否
73	163409	兴全绿色	上市契约型开放式 (LOF)	2,837,800.00	5,817,490.00	0.15	是
74	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	3,254,555.00	5,747,544.13	0.14	否
75	501083	银华科创主题 3 年封闭混合	上市契约型开放式	3,367,772.00	5,634,282.56	0.14	否

			(LOF)				
76	161914	万家创业	上市 契约 型开 放式 (LOF)	6,109,732.00	5,364,344.70	0.13	否
77	161040	创业富国	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,859,630.00	4,762,783.42	0.12	否
78	166027	中欧创业	上市 契约 型开 放式 (LOF)	4,865,089.00	4,758,057.04	0.12	否
79	160325	华夏创业	上市 契约 型开 放式 (LOF)	4,161,544.00	4,515,275.24	0.11	否
80	163418	兴全合兴	上市 契约 型开 放式 (LOF)	4,869,899.00	4,251,421.83	0.11	是
81	501080	中金科创主题 混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,336,189.00	4,025,253.65	0.10	否
82	160143	创业 LOF	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,819,315.00	3,137,897.60	0.08	否

83	510170	国联安商品ETF	交易型开放式(ETF)	637,200.00	2,392,048.80	0.06	否
84	501054	东方红睿泽三年定开混合A	上市契约型开放式(LOF)	1,791,491.00	2,278,776.55	0.06	否
85	168207	中融创业	上市契约型开放式(LOF)	1,434,400.00	1,605,093.60	0.04	否
86	163412	兴全轻资	上市契约型开放式(LOF)	321,000.00	1,052,238.00	0.03	是
87	513090	易方达中证香港证券投资主题ETF	交易型开放式(ETF)	735,000.00	845,985.00	0.02	否
88	506001	万家科创板2年定期开放混合	上市契约型开放式(LOF)	729,400.00	811,092.80	0.02	否
89	160726	嘉实瑞享	上市契约型开放式(LOF)	743,700.00	779,397.60	0.02	否
90	506005	博时科创板三年定开混合	上市契约型开放式	860,800.00	744,592.00	0.02	否

			(LOF)				
91	506003	富国科创板两年定期开放混合	上市契约型开放式(LOF)	100,400.00	83,532.80	0.00	否
92	506002	易方达科创板两年定期开放混合	上市契约型开放式(LOF)	79,400.00	81,543.80	0.00	否
93	506006	汇添富科创板2年定开混合	上市契约型开放式(LOF)	85,700.00	80,472.30	0.00	否
94	501088	嘉实瑞虹三年定期混合	上市契约型开放式(LOF)	64,992.00	79,420.22	0.00	否
95	501096	国联安科技创新3年混合	契约型开放式	11,200.00	10,752.00	0.00	否
96	501098	建信科技创新3年封闭混合	契约型开放式	5,400.00	6,274.80	0.00	否
97	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	100.00	179.98	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本期未出现被监管部门立案调查的情形，未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	163,615.53
2	应收清算款	29,625,012.11
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,327.69
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,789,955.33

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	113044	大秦转债	375,159.80	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	300769	德方纳米	14,894,000.00	0.37	大宗交易购入 流通受限
2	300383	光环新网	10,605,601.04	0.27	非公开发行流 通受限
3	688083	中望软件	7,069,913.76	0.18	询价转让流 通受限
4	688663	新风光	6,978,200.00	0.18	大宗交易购入 流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
兴证全球积极 配置三年封闭 混 合 FOF-LOF A	42,943	93,670.40	80,773,409.34	2.01	3,941,714,453.67	97.99
兴证全球积极 配置三年封闭 混 合 FOF-LOF C	5,177	39,994.61	-	-	207,052,084.57	100.00
合计	48,120	87,895.68	80,773,409.34	2.01	4,148,766,538.24	98.09

8.2 期末上市基金前十名持有人

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	曹建国	6,104,162.00	1.11
2	荣闽龙	4,999,450.00	0.91
3	太玉侠	4,999,450.00	0.91
4	孙惠	4,999,000.00	0.91
5	上海盾笛商贸有限公司	4,999,000.00	0.91
6	杭州恩宝资产管理有 限公司-恩宝芝麻 2 号 私募基金	4,850,742.00	0.88
7	张海涛	4,311,200.00	0.78
8	深圳市前海禾丰正则 资产管理有限公司-禾 丰多元投资一期私募 证券投资基金	4,230,025.00	0.77
9	仟上投资管理(北京) 有限公司-仟上螺丝钉 主动优选天益私募证 券投资基金 2 期	3,762,394.00	0.68
10	傅苏琴	3,168,604.00	0.57

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所	兴证全球积极配置三年封闭混 合 FOF-LOF A	8,720,987.19	0.2168

有从业人员持有本基金	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C	1,362.10	0.0007
	合计	8,722,349.29	0.2062

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）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A	>100
	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A	>100
	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C	0
	合计	>100

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A	兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C
基金合同生效日（2021年11月12日）基金份额总额	4,022,487,939.77	207,052,084.57
本报告期期初基金份额总额	4,022,487,865.40	207,052,084.57
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	2.39	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,022,487,863.01	207,052,084.57

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

1、报告期内，本基金持有的华安智联混合型证券投资基金（LOF）由华安科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满转型而成。根据该基金基金合同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 13 日届满，自 2022 年 6 月 14 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并接受场外、场内申购赎回，基金名称变更为“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，场内简称变更为“华安智联”，场内扩位简称变更为“华安智联 LOF”，场外简称变更为“华安智联混合（LOF）”，基金代码仍为 501073。

2、报告期内，本基金持有的万家科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由万家科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。该基金更名后，场内简称仍为“科创主题”，扩位证券简称变更为“科创主题 LOF”，场外简称变更为“万家科创主题灵活配置混合（LOF）”，A 类基金代码仍为 501075，C 类基金代码仍为 007501。

3、报告期内，本基金持有的鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF），根据《鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止，封闭运作期于 2022 年 6 月 9 日届满，自 2022 年 6 月 10 日起自动

转为上市开放式基金（LOF）并开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“鹏华创新动力灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外简称变更为“鹏华创新动力混合（LOF）”，场内简称变更为“创新动力”，扩位证券简称变更为“鹏华创新动力 LOF”，基金代码仍为 501076。

4、报告期内，本基金持有的富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由富国科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。根据该基金基金合同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，自 2022 年 6 月 13 日起自动转为上市开放式基金（LOF），并开始接受场外、场内申购赎回，基金名称变更为“富国创新企业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，场内简称仍为“科创富国”，场外简称变更为“富国创新企业灵活配置混合（LOF）”，A 类基金份额（即新增 C 类基金份额后由原本基金的基金份额全部自动延续而来）代码仍为 501077。自 2022 年 6 月 13 日起增加 C 类基金份额，C 类基金份额的基金代码为 015849。

5、报告期内，本基金持有的广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满后更名而来。根据《广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后前三年为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 6 月 12 日届满，自 2022 年 6 月 13 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定投业务。基金名称变更为“广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称变更为“广发科创主题灵活配置混合（LOF）”，场内简称仍为“科创配置”，扩位证券简称仍为“科创配置 LOF”，基金代码仍为 501078。

6、报告期内，本基金持有的中欧科创主题混合型证券投资基金（LOF）由中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满开放后更名而来。根据《中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 6 月 27 日届满，自 2022 年 6 月 28 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“中欧科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，基金场外简称变更为“中欧科创主题混合（LOF）”，场内简称仍为“科创中欧”，扩位证券简称变更为“科创中欧 LOF”，基金代码仍为 501081。

7、报告期内，本基金持有的博时科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金，按照该基金基金合同及招募说明书的约定，其封闭期自 2019 年 06 月 27 日至 2022 年 06 月 26 日止，自 2022 年 06 月 27 日起转换为上市开放式基金（LOF），转换后更名为“博时科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，场外简称变更为“博时科创主题灵活配置混合 A”，场内简称、

场内扩位简称与基金代码不变，场内简称为“科创投资”，场内扩位简称为“科创投资 LOF”，基金代码为 501082。

8、报告期内，本基金持有的中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）由中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满开放后更名而来。根据《中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》的约定，基金合同生效后的前 18 个月为封闭运作期，封闭运作期于 2022 年 4 月 10 日届满，自 2022 年 4 月 11 日起进入开放期，开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务，二级市场交易仍照常办理，基金名称变更为“中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称变更为“中欧创新未来混合（LOF）”，场内简称仍为“中欧创新”，扩位证券简称变更为“中欧创新未来 LOF”，基金代码仍为 501208。

9、报告期内，本基金持有的华夏创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金，按照该基金基金合同的约定，根据该基金基金合同约定，该基金的封闭运作期于 2022 年 4 月 12 日届满，该基金自 2022 年 4 月 13 日起不再以封闭方式运作，基金名称变更为“华夏创新未来混合型证券投资基金（LOF）”。该基金更名后，基金简称变更为“华夏创新未来混合（LOF）”，场内简称仍为“华夏创新”，扩位证券简称变更为“华夏创新未来 LOF”，基金代码仍为 501207。

10、报告期内，本基金持有的汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金，根据《汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》，汇添富创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金的封闭运作期将于 2022 年 4 月 12 日届满，自 2022 年 4 月 13 日转为上市开放式基金，基金名称变更为“汇添富创新未来混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称变更为“汇添富创新未来混合（LOF）”，扩位证券简称变更为“添富创新未来 LOF”，基金代码仍为 501206，场内简称仍为“添富创新”。

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	62,991,727.49	78.98	39,911.45	78.89	-
华泰证券	2	16,763,632.10	21.02	10,679.74	21.11	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-	119,688,642.77	32.73
华泰证券	2,839,093.98	100.00	924,600,000.00	100.00	-	-	246,020,082.95	67.27
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于副总经理离任的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-01-21
4	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
5	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
6	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
7	关于增加财达证券为旗下部分基金销	证券时报、指定互联网	2022-04-11

	售机构的公告	网站	
8	关于兴全优选进取三个月持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型证券投资基金中基金（FOF）、兴证全球积极配置三年封闭运作混合型证券投资基金中基金（FOF-LOF）基金经理休假并暂停履行职责的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-05-05
9	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
10	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
11	关于调整网上直销基金转换、赎回转换、汇款交易优惠费率率的公告	证券时报、指定互联网网站	2022-06-17
12	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、基金合同生效后，前三年封闭运作，本基金的封闭期内投资人不能申购、赎回 A 类基金份额和 C 类基金份额，但可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让 A 类基金份额。本基金转为开放式基金（LOF）后，投资人可通过场内、场外两种渠道申购与赎回 A 类基金份额；可通过场外渠道申购与赎回 C 类基金份额。

2、投资者可在二级市场买卖本基金 A 类份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

3、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、中国证监会关于准予兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）注册的批复文件

2、《兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金合同》

3、《兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）托管协议》

4、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

2022 年 8 月 31 日