

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 年第 3 季度报告

2022 年 9 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

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|--------------------------|
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 4,229,539,947.40 份 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 | 4,022,487,862.83 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。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022年7月1日-2022年9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 |
| 1. 本期已实现收益 | -20,904,924.16 | -1,215,781.19 |
| 2. 本期利润 | -352,327,344.77 | -18,234,597.15 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0876 | -0.0881 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,428,515,259.29 | 176,011,460.60 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.8523 | 0.8501 |

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | -9.32% | 0.76% | -11.23% | 0.80% | 1.91% | -0.04% |
| 过去六个月 | -4.76% | 1.00% | -4.34% | 1.08% | -0.42% | -0.08% |
| 自基金合同 生效起至今 | -14.77% | 0.97% | -18.83% | 1.08% | 4.06% | -0.11% |

兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C

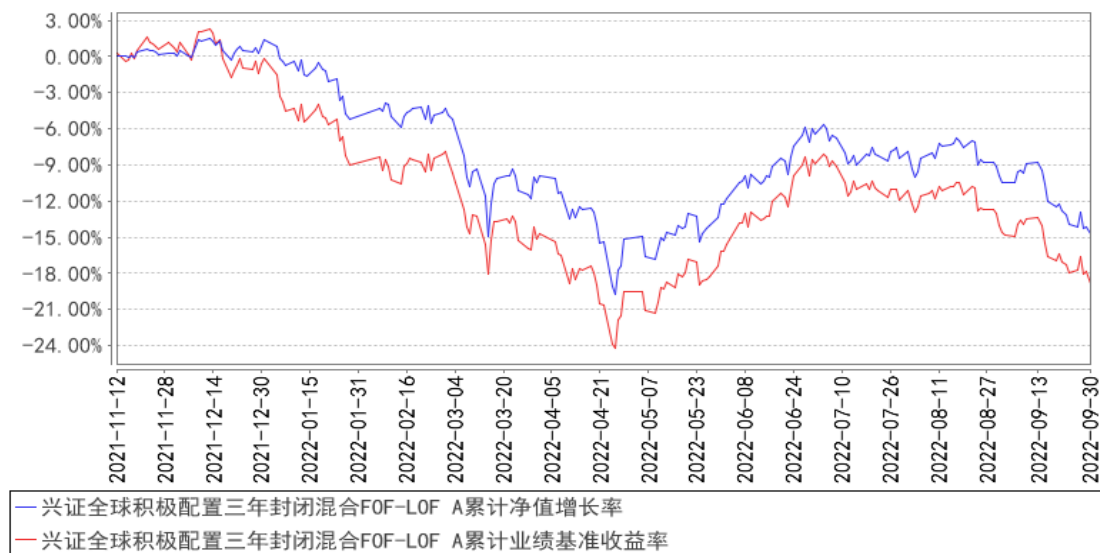
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率 | 业绩比较基 | 业绩比较基 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-------|-------|-------|-----|-----|
|----|--------|-------|-------|-------|-----|-----|

| | | 标准差② | 准收益率③ | 准收益率标准差④ | | |
|------------|---------|-------|---------|----------|--------|--------|
| 过去三个月 | -9.39% | 0.76% | -11.23% | 0.80% | 1.84% | -0.04% |
| 过去六个月 | -4.89% | 1.00% | -4.34% | 1.08% | -0.55% | -0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | -14.99% | 0.97% | -18.83% | 1.08% | 3.84% | -0.11% |

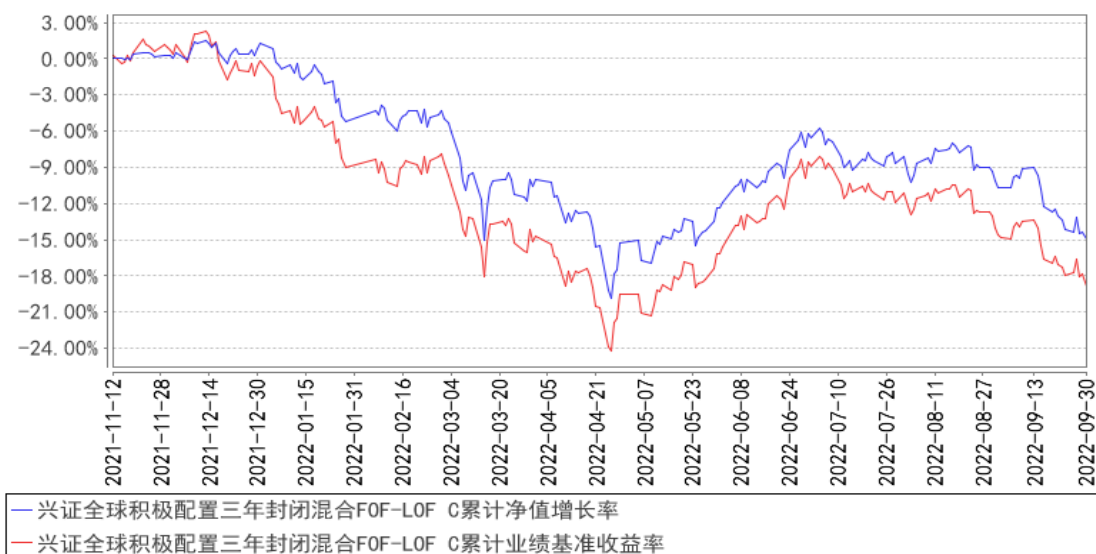
注：本基金成立于 2021 年 11 月 12 日，截至 2022 年 9 月 30 日，本基金成立不满一年。

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 09 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 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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，兴安安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 | 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>(FOF)、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金</p> <p>(FOF)、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金</p> <p>(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</p> <p>(FOF)、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金</p> <p>(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</p> <p>(FOF)、兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金</p> <p>(FOF-LOF)、兴</p> | | | | |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|---|------------------|---|-----|--|
| | 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，自 2022 年 10 月 17 日恢复履行职责，期间由林国怀先生单独管理本基金。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年三季度股票市场大幅调整，全季上证指数下跌 11.01%，从其他主流指数来看，沪深 300 指数下跌 15.16%，创业板指数下跌 18.56%，上证 50 指数下跌 14.66%，中证 500 指数下跌 11.47%，中证 1000 指数下跌 12.45%，科创 50 指数下跌 15.04%；红利类指数表现相对抗跌，中证红利指数下跌 4.63%，上证红利下跌 3.63%。从申万一级行业表现来看，煤炭行业是唯一上涨的行业，涨幅 0.97%，公用事业、石油石化、通信、交通运输、农林牧渔等行业表现也相对较好，跌幅都在 7%以内，建筑材料、电力设备、电子、汽车、传媒、有色金属等行业跌幅均在 16%以上；从风格指数上来看，低价股表现优于中、高价股，低市盈率指数表现优于中、高市盈率指数，中、小盘指数优于大盘指数。债券市场方面，曲线整体变陡。其中，三季度中债总财富指数上涨 1.54%，中债银行间国债财富指数上涨 1.56%，中债信用债总财富指数上涨 1.03%。在收益率曲线上，三季度国债/国开债/信用债收益率曲线整体走平，期限利差整体依旧处于较高水平。信用债方面，1-5 年各期限各资质信用债收益率均下行超 20BP，各期限各资质信用利差略均有压缩。货币市场方面，三季度流动性依旧极其宽松，其中，三季度银行间 1 天回购加权平均利率均

值在 1.29%左右，较二季度均值下行 21bp，银行间 7 天回购利率均值在 1.64%左右，较二季度均值下行 21bp。从基金指数上来看，偏股基金指数下跌 13.23%，中长期纯债基金指数上涨 1.01%，黄金 ETF 净值下跌 0.92%，以人民币计价的标普 500ETF 净值下跌 0.03%，纳斯达克 ETF 净值上涨 0.98%；另外中证转债指数下跌 3.82%。

操作上来看，本季度基金主要采取了以下操作：1、季初略降低组合的超配幅度，随后在市场下跌过程中逐渐提升权益仓位；2、根据既定的策略参与股票定增、大宗交易等投资机会并参与相关的策略型基金，减持解禁的股票和“封转开”的基金。

组合风格上，目前权益部分相对略超配价值风格：经过 2019-2021 年成长风格持续占优的趋势行情后，市场对于“成长性”给予了较高的溢价，所以我们风格上适当的欠配成长、超配价值，尤其是以高股息为主要特征的红利类指数基金；此外，过去几年市场对于估值、下行风险等角度在意程度不足，所以我们在组合中也适当的超配了偏绝对思路的权益型基金以及注重性价比的 GARP 型基金品种；最后，我们继续保持对于投向海外市场的 QDII 基金和另类资产（主要是黄金 ETF）的适度配置。

未来，我们在组合配置策略上依然会“略偏左侧”和“适度均衡”，通过积极挖掘市场上相对收益和绝对收益的投资机会不断增厚组合收益，通过“多资产、多策略”的方式来平滑组合波动，努力将该基金呈现为“相对稳定的‘贝塔’和相对确定的‘阿尔法’特征”。

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。

4.5 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 份额净值为 0.8523 元，本报告期的基金份额净值收益率为-9.32%，同期业绩比较基准收益率为-11.23%，截至本报告期末兴证全球积极配置三年封闭混合 FOF-LOF C 份额净值为 0.8501 元，本报告期的基金份额净值收益率为-9.39%，同期业绩比较基准收益率为-11.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 198,226,307.40 | 5.49 |
| | 其中：股票 | 198,226,307.40 | 5.49 |
| 2 | 基金投资 | 3,335,294,910.81 | 92.39 |
| 3 | 固定收益投资 | 1,016,200.36 | 0.03 |
| | 其中：债券 | 1,016,200.36 | 0.03 |
| | 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 | 61,647,262.38 | 1.71 |
| 8 | 其他资产 | 13,875,747.82 | 0.38 |
| 9 | 合计 | 3,610,060,428.77 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 4,384,609.68 | 0.12 |
| C | 制造业 | 125,072,058.05 | 3.47 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 15,769,625.79 | 0.44 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,289,560.00 | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,340,590.00 | 0.06 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 31,539,385.15 | 0.87 |
| J | 金融业 | 4,896,474.68 | 0.14 |
| K | 房地产业 | 4,891,460.00 | 0.14 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 6,091,618.55 | 0.17 |
| 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 | 376,914.50 | 0.01 |

| | | | |
|---|-----------|----------------|------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,574,011.00 | 0.04 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 198,226,307.40 | 5.50 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 002617 | 露笑科技 | 1,243,781 | 11,119,402.14 | 0.31 |
| 2 | 300769 | 德方纳米 | 40,000 | 10,826,800.00 | 0.30 |
| 3 | 001896 | 豫能控股 | 1,977,459 | 9,511,577.79 | 0.26 |
| 4 | 688663 | 新风光 | 230,000 | 9,128,700.00 | 0.25 |
| 5 | 688303 | 大全能源 | 192,605 | 8,927,241.75 | 0.25 |
| 6 | 002624 | 完美世界 | 520,000 | 6,110,000.00 | 0.17 |
| 7 | 688083 | 中望软件 | 37,128 | 5,732,934.48 | 0.16 |
| 8 | 300496 | 中科创达 | 58,427 | 5,702,122.36 | 0.16 |
| 9 | 688099 | 晶晨股份 | 86,800 | 5,345,732.00 | 0.15 |
| 10 | 000591 | 太阳能 | 818,250 | 5,253,165.00 | 0.15 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 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） | 1,016,200.36 | 0.03 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,016,200.36 | 0.03 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|--------------|--------------|
| 1 | 113044 | 大秦转债 | 9,160 | 1,016,200.36 | 0.03 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 66,800.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | 13,807,777.73 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 1,169.94 |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 13,875,747.82 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 113044 | 大秦转债 | 1,016,200.36 | 0.03 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------------|
| 1 | 002617 | 露笑科技 | 11,119,402.14 | 0.31 | 非公开发行 流通受限 |
| 2 | 300769 | 德方纳米 | 10,826,800.00 | 0.30 | 大宗交易购 入流通受限 |
| 3 | 001896 | 豫能控股 | 9,511,577.79 | 0.26 | 非公开发行 流通受限 |
| 4 | 688663 | 新风光 | 9,128,700.00 | 0.25 | 大宗交易购 入流通受限 |
| 5 | 688303 | 大全能源 | 8,927,241.75 | 0.25 | 非公开发行 流通受限 |
| 6 | 002624 | 完美世界 | 6,110,000.00 | 0.17 | 大宗交易购 入流通受限 |
| 7 | 688083 | 中望软件 | 5,732,934.48 | 0.16 | 询价转让流 通受限 |
| 8 | 000591 | 太阳能 | 5,253,165.00 | 0.15 | 非公开发行 流通受限 |
| 9 | 300496 | 中科创达 | 5,068,642.36 | 0.14 | 非公开发行 流通受限 |
| 10 | 688099 | 晶晨股份 | 4,253,900.00 | 0.12 | 大宗交易购 入流通受限 |

5.11.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

| 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 | 142,466,922.65 | 142,466,922.65 | 3.95 | 是 |
| 2 | 006567 | 中泰星元灵活配置混合A | 契约型开放式 | 58,734,079.53 | 135,616,989.63 | 3.76 | 否 |
| 3 | 100032 | 富国中证红利指数增强A | 契约型开放式 | 129,483,396.91 | 132,590,998.44 | 3.68 | 否 |
| 4 | 000251 | 工银金融地产混合A | 契约型开放式 | 49,487,631.47 | 120,007,506.31 | 3.33 | 否 |
| 5 | 450009 | 国富中小盘股票 | 契约型开放式 | 47,971,490.68 | 115,755,207.01 | 3.21 | 否 |
| 6 | 513500 | 博时标普500ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 89,904,598.00 | 109,234,086.57 | 3.03 | 否 |
| 7 | 004958 | 圆信永丰优享生活混合 | 契约型开放式 | 49,001,350.73 | 99,345,338.47 | 2.76 | 否 |
| 8 | 000628 | 大成高新技术产业股票A | 契约型开放式 | 29,902,062.52 | 97,450,821.75 | 2.70 | 否 |
| 9 | 003293 | 易方达科瑞灵活配置混合 | 契约型开放式 | 46,566,730.67 | 90,125,250.54 | 2.50 | 否 |
| 10 | 166001 | 中欧新趋势混合(LOF)A | 上市契约型开放式(LOF) | 67,798,333.32 | 88,490,384.65 | 2.45 | 否 |

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2022年7月1日至2022年9月30日 | 其中：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 |
|----------------------|---------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | 5,000.00 | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | 648,543.70 | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 43,592.78 | 3,888.60 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 11,029,565.56 | 1,484,488.59 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 1,877,140.77 | 253,247.71 |

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

1、大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）由大成科创主题 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。大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2019 年 6 月 6 日证监许可【2019】1012 号文予以注册。基金合同于 2019 年 7 月 18 日正式生效。《大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效后的前 3 年本基金处于封闭运作期。大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）至 3 年后的年度对日前一日止，封闭运作期届满后，本基金 2022 年 7 月 18 日转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场内、场外申购和赎回，场外简称变更为“大成科创主题混合（LOF）”，场内简称、基金代码不变，场内简称为“科创大成”，场内扩位简称为“科创大成 LOF”，基金代码为“501079”。

2、中金科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）由中金科创主题 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更名而来。根据《中金科创主题 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，封闭运作期将于 2022 年 7 月 10 日届满，自 2022 年 7 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。本基金更名后，场外基金简称变更为“中金科创主题灵活配置混合（LOF）”场内简称仍为“科创中金”，扩位简称变更为“科创主题投资基金 LOF”，基金代码仍为“501080”。

3、根据银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金《基金合同》及《招募说明书》的相关规定，银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的封闭期自 2019 年 7 月 5 日至 2022 年 7 月 5 日止，自 2022 年 7 月 6 日起，本基金转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为银华科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF），场外基金简称变更为“银华科创主题灵活配置混合（LOF）”，扩位证券简称变更为“科创银华 LOF”，场内基金简称及代码不变。

4、根据《财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，财通科创主题 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将于 2022 年 7 月 10 日届满，自 2022 年 7 月 11 日转为上市开放式基金，基金名称变更为“财通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“财通科创主题灵活配置混合（LOF）”，扩位证券简称变更为“财通科创 LOF”，基金代码仍为 501085，场内简称仍为“科创财通”。

§ 7 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 |
|---------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 4,022,487,863.01 | 207,052,084.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 0.18 | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 4,022,487,862.83 | 207,052,084.57 |

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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 |
|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 0.00 | 0.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.00 | 0.00 |

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期未运用固有资金对本基金进行交易。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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基金份额，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。

§ 10 备查文件目录

10.1 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

10.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

10.3 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。

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 10 月 26 日