

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型 基金中基金(FOF) 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.10 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	16
§ 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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
8.3 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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 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	68
8.7 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	68
8.8 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	68
8.9 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	68
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 本报告期投资基金情况	69
8.13 投资组合报告附注	77
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79
9.3 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	79
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	80
§ 10 开放式基金份额变动	80
§ 11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
11.2 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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
11.4 基金投资策略的改变	81
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	81
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	83
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.9 其他重大事件	88
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	91
12.1 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	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	92
§ 13 备查文件目录	92
13.1 备查文件目录	92
13.2 存放地点	92
13.3 查阅方式	92

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)	
基金简称	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF	
基金主代码	006580	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 25 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,027,127,605.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y
下属分级基金的交易代码	006580	017672
报告期末下属分级基金的份额总额	1,027,118,943.24 份	8,662.63 份

注：本基金每份基金份额最短持有期为三年。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值。主要投资策略包括资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、风险控制策略等。（详见基金合同及招募说明书更新）
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%。
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555

传真	021-20398988	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区金陵东路368号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	201204	518040
法定代表人	杨华辉	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28-30楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

	2022年		2021年		2020年	
	2022年	2022年12月29日(基金合同生效日)-2022年12月31日	2021年	2021年	2020年	2020年
3.1.1 期间数据和指标	兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y	兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y	兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y
本期已实现收益	35,485,401.35	-0.12	216,725,005.47	-	167,040,610.59	-

本期利润	-160,073,165.43	28.45	122,708,807.09	-	332,108,956.29	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1417	0.0033	0.0964	-	0.3309	-
本期加权平均净值利润率	-9.29%	0.22%	6.07%	-%	24.24%	-%
本期基金份额净值增长率	-8.06%	0.00%	6.36%	-%	26.89%	-%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	476,356,112.62	4,017.95	592,703,384.78	-	296,159,748.32	-
期末可供分配基金份额利润	0.4638	0.4638	0.4334	-	0.2598	-
期末基金资产净值	1,543,180,968.09	13,015.46	2,234,773,522.64	-	1,751,274,838.01	-
期末基金份额净值	1.5024	1.5025	1.6341	-	1.5364	-
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	50.24%	0.00%	63.41%	-%	53.64%	-%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

4、本基金于2022年12月24日公告增设Y类基金份额，并于2022年12月30日开始办理申购等相关业务。

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

兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF 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

过去三个月	1.51%	0.50%	-0.12%	0.56%	1.63%	-0.06%
过去六个月	-3.66%	0.47%	-6.56%	0.52%	2.90%	-0.05%
过去一年	-8.06%	0.58%	-10.89%	0.64%	2.83%	-0.06%
过去三年	24.08%	0.58%	14.36%	0.67%	9.72%	-0.09%
自基金合同生效 起至今	50.24%	0.59%	35.47%	0.65%	14.77%	-0.06%

兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y

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
自 2022 年 12 月 30 日起至今	0.00%	0.00%	0.08%	0.05%	-0.08%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：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。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：

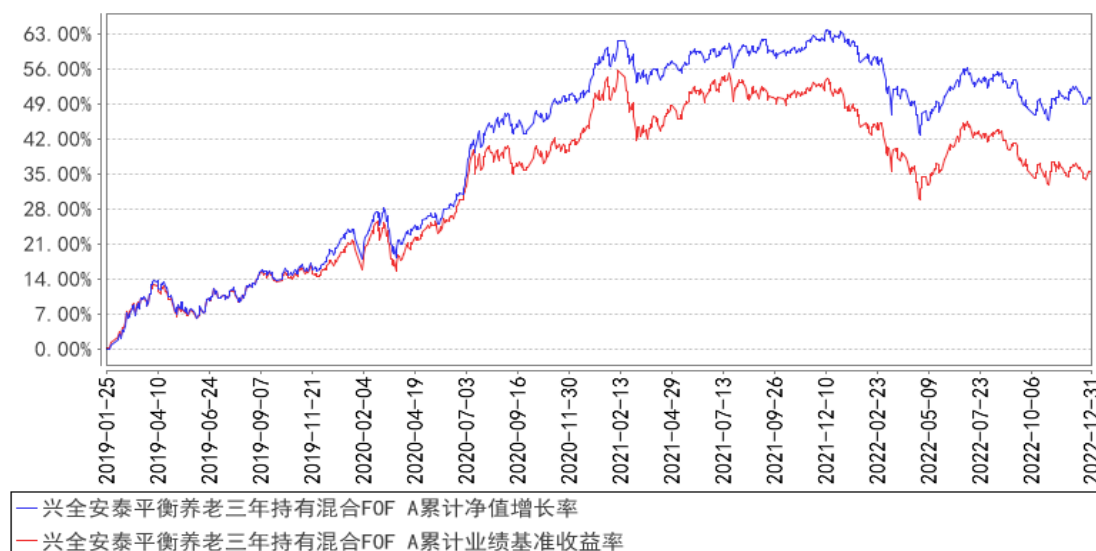
$$\text{Return}_t = 50\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率}_t / \text{中证偏股型基金指数收益率}_{t-1} - 1) + 50\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

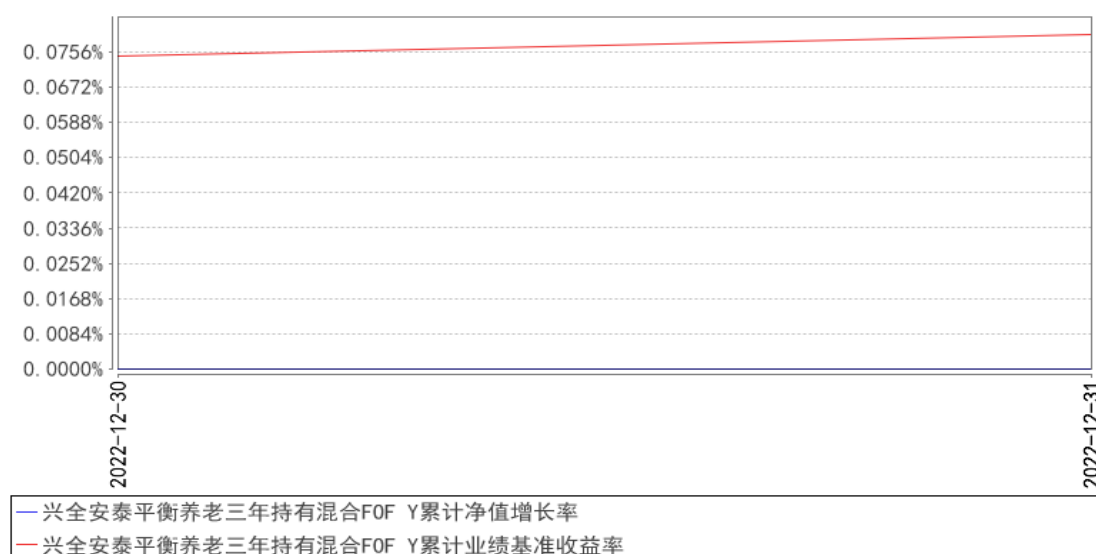
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF 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



兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y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



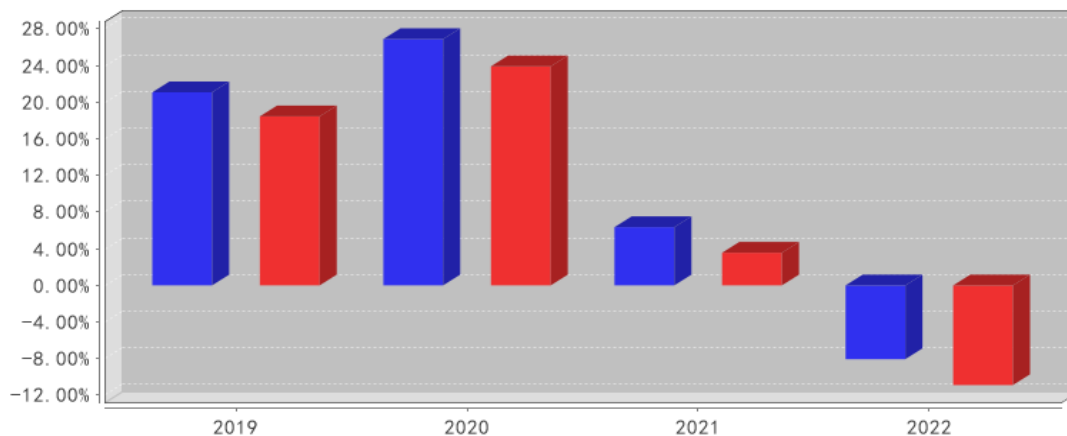
注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2019 年 1 月 25 日至 2019 年 7 月 24 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、本基金于 2022 年 12 月 24 日公告增设 Y 类基金份额，并于 2022 年 12 月 30 日开始办理申购等相关业务。

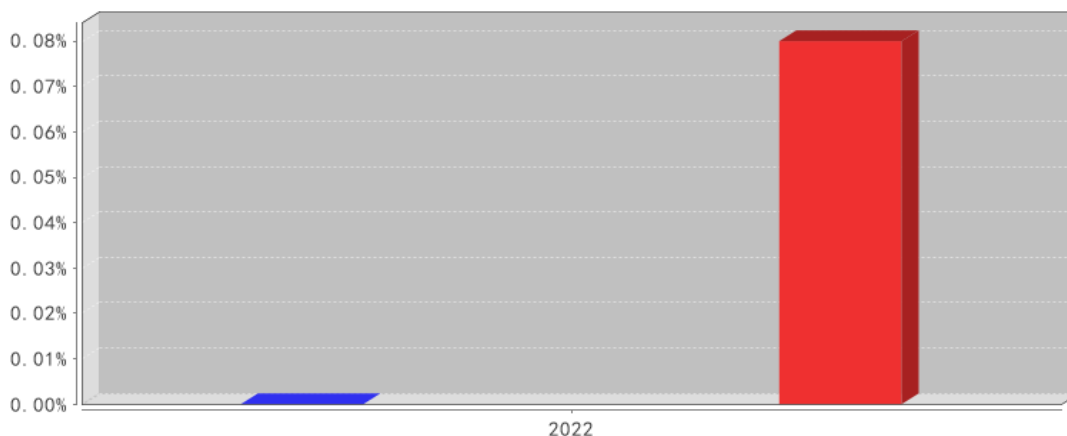
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A净值增长率
 ■ 兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A业绩基准收益率

兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y净值增长率
 ■ 兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y业绩基准收益率

注：1、本基金 A 类份额的 2019 年数据统计期间为 2019 年 1 月 25 日（基金合同生效之日）至 2019 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算；

2、本基金于 2022 年 12 月 24 日公告增设 Y 类基金份额，并于 2022 年 12 月 30 日开始办理申购等相关业务。Y 类份额的 2022 年数据统计期间为 2022 年 12 月 30 日至 2022 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注：无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2022年12月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共55只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF等类型。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林国怀	FOF投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选	2019年1月25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>进取三个月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基金中基金 (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)、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混</p>				
--	--	--	--	--	--

	合型基金 中基金 (FOF)基 金经理				
--	------------------------------	--	--	--	--

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，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易管理办法》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年市场跌宕起伏，全年来看各类指数均以下跌收官。主流指数中，上证综指下跌15.13%，上证50指数下跌19.52%，沪深300指数下跌21.63%，中证500指数下跌20.31%，中证1000指数下跌21.58%，创业板指数下跌29.37%，科创50指数下跌31.35%。从申万一级行业表现来看，仅煤炭和综合行业收涨，涨幅分别为10.95%和10.57%，社会服务、交通运输行业的表现相对靠前，跌幅在5%以内，其余行业下跌幅度均相对较大，尤其是电子行业的跌幅最大，达36.54%。从风格指数上来看，中、低价股指数表现优于高价股指数，低市净率/市盈率表现高于中、高市净率/市盈率，亏损股表现优于微利股、绩优股，大中小盘指数表现差异不大。债券市场方面，中债总财富指数上涨3.37%，中债银行间国债财富指数上涨3.39%，中债企业债总财富指数上涨3.13%。从基金指数上看，中证偏股基金指数下跌21.80%，中长期纯债基金指数上涨2.17%，黄金ETF净值上涨9.42%，以人民币计价的标普500ETF净值下跌11.94%，纳斯达克ETF净值下跌27.26%；另外中证转债指数下跌10.02%。

回顾全年，本基金主要采取了以下操作。在资产配置层面，本基金坚持50%的权益类资产和50%的固定收益类资产的战略资产配置；在战术资产配置上，视市场情况对权益类资产进行了适度低买高卖的操作，分别在年初、年中调整权益配置比例在平配状态，而在4月份、10月份市场步入相对低估区间时，增加了权益配置比例到略微超配。在风格配置上，现阶段本基金依然保持超配在价值风格，但期间随着成长股的大幅调整，本基金逐步降低了组合中价值型基金的比例，适度提升了成长型基金的比例；同时，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。随着市场调整，组合还小幅增加了美股和港股基金的配置比例。

债券资产部分，8月中下旬鉴于债券收益率接近历史极低位置，尤其信用利差压缩至极限，我们略微降低了整体债基部分的久期，将部分中长债基金品种替换为短债品种；11月中旬将组合中的部分信用债基替换为利率债基，适度规避债券市场的流动性风险；12月份中下旬随着债券市场的快速调整，适度增加回信用债券基金的配置，并小幅提升可转债的配置比例。

从全年来看，我们的组合跑赢了业绩比较基准，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

截至本报告期末兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A 的基金份额净值为 1.5024 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.06%，同期业绩比较基准收益率为-10.89%；截至本报告期末兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y 的基金份额净值为 1.5025 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.08%。

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、外的宏观形势均有好转，国内中央经济工作会议释放较大政策转向信号，经济有望筑底回升，美国通胀数据拐点出现，美联储可能放缓加息步伐。此外，A 股市场在经历全年的大幅下挫后，估值得到了一定程度的消化，股票相对债券的吸引力恢复到了较高的位置。

对此，我们对权益资产保持相对乐观的态度。我们将保持一贯的“略偏左侧”和“适度均衡”的配置策略，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”。

本基金是一只平衡型的养老目标基金，权益类资产的配置中枢为 50%，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和养老储备。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司风险管理部还对一些无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.9 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2302635 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了后附的兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金(FOF)（以下简称“兴全安泰养老目标基金(FOF)”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了兴全安泰养老目标基金(FOF) 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴全安泰养老目标基金(FOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审

	计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	不适用
其他信息	<p>兴全安泰养老目标基金 (FOF) 管理人兴证全球基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全安泰养老目标基金 (FOF) 2022 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作, 如果我们确定其他信息存在重大错报, 我们应当报告该事实。在这方面, 我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估兴全安泰养老目标基金 (FOF) 的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非兴全安泰养老目标基金 (FOF) 预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全安泰养老目标基金 (FOF) 的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程</p>

	<p>序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴全安泰养老目标基金 (FOF) 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴全安泰养老目标基金 (FOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	王国蓓 欧梦澈
会计师事务所的地址	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
审计报告日期	2023 年 03 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	22,566,359.85	19,088,265.34
结算备付金		6,505.59	853,008.25
存出保证金		9,028.35	64,596.22
交易性金融资产	7.4.7.2	1,523,694,266.29	2,161,554,500.76
其中：股票投资		52,352,650.10	68,471,176.11
基金投资		1,375,250,765.01	1,944,802,705.55
债券投资		96,090,851.18	148,280,619.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		112,639.50	50,035,527.94
应收股利		92,374.13	470,362.89
应收申购款		799,550.74	1,948,658.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	37.57	1,975,859.49
资产总计		1,547,280,762.02	2,235,990,778.93
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,205,325.53	-
应付管理人报酬		517,996.59	673,650.40
应付托管费		186,043.48	249,729.89
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		306.13	316.86
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	177,106.74	293,559.14
负债合计		4,086,778.47	1,217,256.29
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,027,127,605.87	1,367,579,704.12
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	516,066,377.68	867,193,818.52
净资产合计		1,543,193,983.55	2,234,773,522.64
负债和净资产总计		1,547,280,762.02	2,235,990,778.93

注：1、报告截止日2022年12月31日，兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF A基金份额净值1.5024元，基金份额总额1,027,118,943.24份；兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF Y基金份额净值1.5025元，基金份额总额8,662.63份。兴全安泰平衡养老三年持有混合FOF份额总额合计为1,027,127,605.87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。

7.2 利润表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-151,198,523.47	134,935,731.90
1. 利息收入		437,274.03	3,518,944.82
其中：存款利息收入	7.4.7.13	179,396.43	176,001.68
债券利息收入		-	3,302,578.54
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融 资产收入		257,877.60	40,364.60
证券出借利息 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		43,920,279.37	225,431,650.35
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,113,625.93	33,382,426.53
基金投资收益	7.4.7.15	12,978,361.78	158,811,133.88
债券投资收益	7.4.7.16	3,792,526.09	1,534,340.90
资产支持证券 投资收益	7.4.7.17	-	-
贵金属投资收 益	7.4.7.18	-	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-	-
股利收益	7.4.7.20	25,035,765.57	31,703,749.04
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）	7.4.7.21	-195,558,538.21	-94,016,198.38

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	2,461.34	1,335.11
减：二、营业总支出		8,874,613.51	12,226,924.81
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,292,476.80	7,249,798.96
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,376,226.16	2,679,443.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	12,983.43
其中：卖出回购金融资产支出		-	12,983.43
6. 信用减值损失	7.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		148.48	52,178.85
8. 其他费用	7.4.7.25	205,762.07	2,232,519.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-160,073,136.98	122,708,807.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-160,073,136.98	122,708,807.09
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-160,073,136.98	122,708,807.09

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。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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）	1,367,579,704.12	-	867,193,818.52	2,234,773,522.64
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)	1,367,579,704.12	-	867,193,818.52	2,234,773,522.64
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	-340,452,098.25	-	-351,127,440.84	-691,579,539.09
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-160,073,136.98	-160,073,136.98
(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)	-340,452,098.25	-	-191,054,303.86	-531,506,402.11
其中：1. 基 金 申 购 款	146,372,945.24	-	76,877,660.69	223,250,605.93
2. 基 金 赎 回 款	-486,825,043.49	-	-267,931,964.55	-754,757,008.04
(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)	1,027,127,605.87	-	516,066,377.68	1,543,193,983.55
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	1,139,882,869.63	-	611,391,968.38	1,751,274,838.01
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)	1,139,882,869.63	-	611,391,968.38	1,751,274,838.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	227,696,834.49	-	255,801,850.14	483,498,684.63
(一)、综合收益总额	-	-	122,708,807.09	122,708,807.09
(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)	227,696,834.49	-	133,093,043.05	360,789,877.54
其中: 1. 基金申购款	227,696,834.49	-	133,093,043.05	360,789,877.54
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、本期期末净资产(基金净值)	1,367,579,704.12	-	867,193,818.52	2,234,773,522.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

庄园芳

詹鸿飞

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (以下简称“本基金”) 系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 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”) 以证监许可[2018]1665 号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集基金份额为 628,976,962.65 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(19)第 00052 号验资报告。基金合同于 2019 年 1 月 25 日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司, 托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括 QDII 基金和香港互认基金)、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债

券、公司债券、中小企业私募债、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。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金的权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%。

本基金的业绩比较基准为：中证偏股型基金指数收益率×50%+中债综合（全价）指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 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 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和基金投资等。

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。

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。本基金现无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。

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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(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；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) 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：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 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。

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。

7.4.4.5 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，参考类似金融工具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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资；本基金 A 类基金份额的投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金 A 类基金份额默认的收益分配方式是现金分红；本基金 Y 类份额的收益分配方式是红利再投资；基金收益分配后各类基金份额的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的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况下，本基金根据以下原则进行估值：

(1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自2022年1月1日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年中国证监会发布修订的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度和中期报告〉》。

(a) 新金融工具准则

根据财政部发布的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业务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。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 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、买入返售金融资产和应收利息，对应的账面价值分别为人民币 19,088,265.34 元、853,008.25 元、64,596.22 元、0.00 元和 1,975,433.44 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、存出保证金和买入返售金融资产，对应的账面价值分别为人民币 19,094,675.35 元、853,430.54 元、64,628.12 元和-21,316.76 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 2,161,554,500.76 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，对应的账面价值为人民币 2,163,544,386.76 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和其他负债，对应的账面价值分别为人民币 123,559.14 元和 170,000.00 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 293,559.14 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金和交易性金融资产等对应的应计利息余额均列示在应收利息中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金和交易性金融资产等科目下列示，无期初留存收益影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

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，资管产品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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	22,566,359.85	19,088,265.34
等于：本金	22,563,739.95	19,088,265.34
加：应计利息	2,619.90	-
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	22,566,359.85	19,088,265.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		57,885,669.88	-	52,352,650.10	-5,533,019.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,680,157.56	173,984.52	24,925,185.42	71,043.34
	银行间市场	70,091,070.00	1,146,665.76	71,165,665.76	-72,070.00
	合计	94,771,227.56	1,320,650.28	96,090,851.18	-1,026.66
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,412,069,268.68	-	1,375,250,765.01	-36,818,503.67
其他		-	-	-	-
合计		1,564,726,166.12	1,320,650.28	1,523,694,266.29	-42,352,550.11
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		56,461,193.24	-	68,471,176.11	12,009,982.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	35,838,538.26	-	38,087,619.10	2,249,080.84
	银行间市场	110,387,670.00	-	110,193,000.00	-194,670.00
	合计	146,226,208.26	-	148,280,619.10	2,054,410.84
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,805,661,111.16	-	1,944,802,705.55	139,141,594.39
其他		-	-	-	-
合计		2,008,348,512.66	-	2,161,554,500.76	153,205,988.10

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金本报告期末及上年度末各项买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本报告期末及上年度末本基金均无债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本报告期末及上年度末本基金均无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	1,975,433.44
其他应收款	37.57	426.05
待摊费用	-	-
合计	37.57	1,975,859.49

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	7,106.74	123,559.14
其中：交易所市场	6,931.74	123,559.14
银行间市场	175.00	-
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	177,106.74	293,559.14

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,367,579,704.12	1,367,579,704.12
本期申购	146,364,282.61	146,364,282.61
本期赎回 (以“-”号填列)	-486,825,043.49	-486,825,043.49
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	1,027,118,943.24	1,027,118,943.24

兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y

项目	本期 2022 年 12 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	8,662.63	8,662.63
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	8,662.63	8,662.63

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	592,703,384.78	274,490,433.74	867,193,818.52
本期利润	35,485,401.35	-195,558,566.78	-160,073,165.43
本期基金份额交易产生的变动数	-151,832,673.51	-39,225,954.73	-191,058,628.24
其中：基金申购款	65,787,267.35	11,086,068.96	76,873,336.31
基金赎回款	-217,619,940.86	-50,312,023.69	-267,931,964.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	476,356,112.62	39,705,912.23	516,062,024.85

兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-0.12	28.57	28.45
本期基金份额交易产生的变动数	4,018.07	306.31	4,324.38
其中：基金申购款	4,018.07	306.31	4,324.38
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,017.95	334.88	4,352.83

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	162,918.37	162,766.95
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	14,961.68	6,433.99
其他	1,516.38	6,800.74
合计	179,396.43	176,001.68

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	2,113,625.93	33,382,426.53
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	2,113,625.93	33,382,426.53

7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	36,970,316.49	293,293,566.96
减：卖出股票成本 总额	34,784,505.48	259,911,140.43
减：交易费用	72,185.08	-
买卖股票差价收 入	2,113,625.93	33,382,426.53

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 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12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
卖出/赎回基金成交总额	975,238,931.39	933,538,571.14
减：卖出/赎回基金成本总额	961,947,340.28	774,727,437.26
减：买卖基金差价收入应缴 纳增值税额	-	-

减：交易费用	313,229.33	-
基金投资收益	12,978,361.78	158,811,133.88

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	2,294,151.99	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,498,374.10	1,534,340.90
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	3,792,526.09	1,534,340.90

7.4.7.16.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	153,392,686.45	122,149,621.99
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	148,498,670.07	117,606,384.65
减：应计利息总额	3,394,358.54	3,008,896.44
减：交易费用	1,283.74	-
买卖债券差价收入	1,498,374.10	1,534,340.90

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未进行衍生工具买卖交易。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	568,312.13	2,811,867.64
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	24,467,453.44	28,891,881.40
合计	25,035,765.57	31,703,749.04

7.4.7.21 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-195,558,538.21	-94,016,198.38
股票投资	-17,543,002.65	-8,891,770.83
债券投资	-2,055,437.50	2,141,462.24
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-175,960,098.06	-87,265,889.79
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	-195,558,538.21	-94,016,198.38

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	2,461.34	1,335.11
合计	2,461.34	1,335.11

7.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服	10,705.00	224,343.89

务费 (元)		
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	13,173,963.65	14,099,816.91
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	2,566,954.65	2,848,159.80

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。

7.4.7.24 信用减值损失

无。

7.4.7.25 其他费用

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	17,762.07	23,660.98
账户维护费用	18,000.00	18,000.00
交易费用	-	2,020,858.64
合计	205,762.07	2,232,519.62

7.4.7.26 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司 (“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司 (“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V)	基金管理人的股东
兴证全球资本管理(上海)有限公司(“兴证全球资本”)	基金管理人控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	42,205,731.49	100.00	409,944,950.24	100.00

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	45,493,820.91	100.00	52,930,149.42	100.00

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	2,288,700,000.00	100.00	210,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日

	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
兴业证券	105,046,341.45	100.00	490,314,263.37	100.00

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 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12月31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	31,643.99	100.00	6,931.74	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	329,586.75	100.00	123,559.14	100.00

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	6,292,476.80
其中：支付销售机构的客户维护费	3,636,264.21	4,347,743.61

注：兴全安泰养老目标基金(FOF) A 的基金管理费按前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）×0.5%/当年天数

兴全安泰养老目标基金(FOF) Y 的基金管理费按前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）的 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算

公式为：日基金管理费=前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金管理人所管理的基金的部分）×0.25%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,376,226.16	2,679,443.95

注：兴全安泰养老目标基金(FOF) A 的基金托管费按前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）的0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）×0.15%/当年天数

兴全安泰养老目标基金(FOF) Y 的基金托管费按前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）的0.075%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日该类别基金资产净值（扣除投资于本基金托管人所托管的基金的部分）×0.075%/当年天数

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

7.4.10.4.2 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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	本期 2022年12月29日(基金合 同生效日)至2022年12月 31日
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有 混合 FOF Y
基金合同生效日(2019年1 月25日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,350.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,350.04	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.9736%	-%
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 -
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有 混合 FOF Y
基金合同生效日(2019年1 月25日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,350.04	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,350.04	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.7312%	-%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 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12月 31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	22,566,359.85	162,918.37	19,088,265.34	162,766.95

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**7.4.10.8.1 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330,671,327.64元，占本基金资产净值的比例为21.43%。

7.4.10.8.2 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31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）	3,070.25	71,076.79
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,447.68	1,348.86
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	3,120,742.09	4,000,571.10
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	692,529.51	887,366.83

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。

根据本基金合同的约定，本基金管理人运用本基金基金财产申购自身管理的基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
000591	太阳能	2022年8月16日	6个月	非公开发行流通受限	6.63	7.12	226,244	1,499,997.72	1,610,857.28	-
001896	豫能控股	2022年7月5日	6个月	非公开发行流通受限	4.88	5.21	614,754	2,999,999.52	3,202,868.34	-
002053	云南能投	2022年9月19日	6个月	非公开发行流通受限	11.68	10.66	128,425	1,500,004.00	1,369,010.50	-
002108	沧州明珠	2022年8月9日	6个月	非公开发行流通受限	4.86	4.52	308,641	1,499,995.26	1,395,057.32	-
002487	大金重工	2022年12月30日	6个月	非公开发行流通受限	37.35	37.35	40,161	1,500,013.35	1,500,013.35	-
002617	露笑科技	2022年7月21日	6个月	非公开发行流通受限	8.04	9.03	373,134	2,999,997.36	3,369,400.02	-
002928	华夏航空	2022年12月1日	6个月	非公开发行流通受限	9.20	13.03	163,043	1,499,995.60	2,124,450.29	-
300496	中科创达	2022年9月27日	6个月	非公开发行流通受限	103.00	95.15	14,563	1,499,989.00	1,385,669.45	-
300982	苏文电能	2022年12月23日	6个月	非公开发行流通受限	45.26	45.14	16,571	750,003.46	748,014.94	-
600328	中盐化工	2022年11月28日	6个月	非公开发行流通受限	12.51	13.84	119,904	1,499,999.04	1,659,471.36	-
600703	三安光电	2022年12月	6个月	非公开发行流	15.50	16.04	96,774	1,499,997.00	1,552,254.96	-

		14日		通受限						
601698	中国卫通	2022年10月25日	6个月	非公开发行流通受限	9.60	10.89	156,250	1,500,000.00	1,701,562.50	-
603982	泉峰汽车	2022年12月13日	6个月	非公开发行流通受限	19.76	18.39	75,911	1,500,001.36	1,396,003.29	-
688008	澜起科技	2022年11月10日	6个月	询价转让流通受限	54.01	58.12	14,334	774,179.34	833,092.08	-
688033	天宜上佳	2022年10月28日	6个月	非公开发行流通受限	20.81	20.15	11,644	242,311.64	234,626.60	-
688097	博众精工	2022年12月13日	6个月	非公开发行流通受限	24.75	26.94	30,303	749,999.25	816,362.82	-
688099	晶晨股份	2022年9月13日	6个月	大宗交易购入流通受限	72.23	66.25	30,000	2,166,900.00	1,987,500.00	-
688303	大全能源	2022年7月22日	6个月	非公开发行流通受限	51.79	47.02	57,926	2,999,987.54	2,723,680.52	-
688668	鼎通科技	2022年12月20日	6个月	非公开发行流通受限	60.01	60.79	12,498	750,004.98	759,753.42	-

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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（不含证券投资基金）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（不含证券投资基金），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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	10,906,706.72	29,700,548.60
AAA以下	2,674,661.49	3,390,576.50
未评级	-	-
合计	13,581,368.21	33,091,125.10

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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 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在开放赎回日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为具有一定持有期的开放式基金，符合条件的其他投资者可在合同规定的开放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。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	22,566,359.85	-	-	-	-	-	22,566,359.85
结算备付金	6,505.59	-	-	-	-	-	6,505.59
存出保证金	9,028.35	-	-	-	-	-	9,028.35
交易性金融资产	-	10,153,145.21	72,356,337.76	12,835,787.98	745,580.23	1,427,603,415.11	1,523,694,266.29
应收股利	-	-	-	-	-	92,374.13	92,374.13
应	58,126.89	-	-	-	-	741,423.85	799,550.74

收申购款							
应收清算款						112,639.50	112,639.50
其他资产						37.57	37.57
资产总计	22,640,020.68	10,153,145.21	72,356,337.76	12,835,787.98	745,580.23	1,428,549,890.16	1,547,280,762.02
负债							
应付赎回款						3,205,325.53	3,205,325.53
应付管理人报酬						517,996.59	517,996.59
应付托管费						186,043.48	186,043.48
应交税费						306.13	306.13
其他负债						177,106.74	177,106.74
负						4,086,778.47	4,086,778.47

债总计							
利率敏感度缺口	22,640,020.68	10,153,145.21	72,356,337.76	12,835,787.98	745,580.23	1,424,463,111.69	1,543,193,983.55
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	19,088,265.34	-	-	-	-	-	19,088,265.34
结算备付金	853,008.25	-	-	-	-	-	853,008.25
存出保证金	64,596.22	-	-	-	-	-	64,596.22
交易性金融资产	-	-	115,189,494.00	32,468,761.90	622,363.20	2,013,273,881.66	2,161,554,500.76
应	-	-	-	-	-	470,362.89	470,362.89

收股利							
应收申购款	92,922.82	-	-	-	-	1,855,735.22	1,948,658.04
应收证券清算款	-	-	-	-	-	50,035,527.94	50,035,527.94
其他资产	-	-	-	-	-	1,975,859.49	1,975,859.49
资产总计	20,098,792.63	-	115,189,494.00	32,468,761.90	622,363.20	2,067,611,367.20	2,235,990,778.93
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	673,650.40	673,650.40
应付托管费	-	-	-	-	-	249,729.89	249,729.89
应交税费	-	-	-	-	-	316.86	316.86
其他负债	-	-	-	-	-	293,559.14	293,559.14

负债总计	-	-	-	-	-	1,217,256.29	1,217,256.29
利率敏感度缺口	20,098,792.63	-	115,189,494.00	32,468,761.90	622,363.20	2,066,394,110.91	2,234,773,522.64

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。

7.4.13.4.1.2 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12月31日)	上年度末(2021年12月31日)	
分析	1. 市场利率-1%	202,204.18	519,476.87
	2. 市场利率+1%	-201,161.83	-514,523.01

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。

7.4.13.4.2 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	52,352,650.10	3.39	68,471,176.11	3.06
交易性金融资产—基金投资	1,375,250,765.01	89.12	1,944,802,705.55	87.02
交易性金融资产—债券投资	96,090,851.18	6.23	148,280,619.10	6.64
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	1,523,694,266.29	98.74	2,161,554,500.76	96.72

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)	
分析	业绩比较基准+10%	136,607,826.11	156,285,897.85
	业绩比较基准-10%	-136,607,826.11	-156,285,897.85

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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,410,815,134.28	2,008,921,871.68
第二层次	82,509,482.97	117,085,047.49
第三层次	30,369,649.04	35,547,581.59
合计	1,523,694,266.29	2,161,554,500.76

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。

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	35,547,581.59	35,547,581.59
当期购买	-	35,175,314.00	35,175,314.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-

转出第三层次	-	35,532,424.98	35,532,424.98
当期利得或损失总额	-	-4,820,821.57	-4,820,821.57
其中：计入损益的利得或损失	-	-4,820,821.57	-4,820,821.57
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	30,369,649.04	30,369,649.04
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	936,273.62	936,273.62
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	56,889,835.46	56,889,835.46
当期购买	-	58,577,021.25	58,577,021.25
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	97,959,823.80	97,959,823.80
当期利得或损失总额	-	18,040,548.68	18,040,548.68
其中：计入损益的利得或损失	-	18,040,548.68	18,040,548.68
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	35,547,581.59	35,547,581.59
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	8,630,155.68	8,630,155.68

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	30,369,649.04	亚式期权模型	预期波动率	0.2585- 0.6227	负相关
项目	上年度末公允	采用的估	不可观察输入值		

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票	35,547,581.59	亚式期权模型	预期波动率	0.1717-2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 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)。

7.4.14.4 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和其他金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	52,352,650.10	3.38
	其中: 股票	52,352,650.10	3.38
2	基金投资	1,375,250,765.01	88.88
3	固定收益投资	96,090,851.18	6.21
	其中: 债券	96,090,851.18	6.21
	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	22,572,865.44	1.46
8	其他各项资产	1,013,630.29	0.07
9	合计	1,547,280,762.02	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
C	制造业	34,899,973.50	2.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,916,205.62	0.32
E	建筑业	748,014.94	0.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,124,450.29	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,094,849.75	0.52
J	金融业	635,628.00	0.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	591,300.00	0.04
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	342,228.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	52,352,650.10	3.39

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 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	002617	露笑科技	373,134	3,369,400.02	0.22
2	001896	豫能控股	614,754	3,202,868.34	0.21
3	688303	大全能源	57,926	2,723,680.52	0.18
4	002415	海康威视	68,100	2,361,708.00	0.15
5	002928	华夏航空	163,043	2,124,450.29	0.14
6	688099	晶晨股份	30,000	1,987,500.00	0.13
7	002064	华峰化学	268,324	1,824,603.20	0.12
8	600309	万华化学	19,100	1,769,615.00	0.11
9	601698	中国卫通	156,250	1,701,562.50	0.11
10	600328	中盐化工	119,904	1,659,471.36	0.11
11	000591	太阳能	226,244	1,610,857.28	0.10
12	600703	三安光电	96,774	1,552,254.96	0.10
13	002487	大金重工	40,161	1,500,013.35	0.10

14	603982	泉峰汽车	75,911	1,396,003.29	0.09
15	002108	沧州明珠	308,641	1,395,057.32	0.09
16	300496	中科创达	14,563	1,385,669.45	0.09
17	002053	云南能投	128,425	1,369,010.50	0.09
18	002555	三七互娱	75,300	1,362,930.00	0.09
19	600690	海尔智家	54,700	1,337,962.00	0.09
20	002920	德赛西威	12,300	1,295,682.00	0.08
21	600519	贵州茅台	600	1,036,200.00	0.07
22	603517	绝味食品	15,900	971,331.00	0.06
23	600570	恒生电子	20,930	846,827.80	0.05
24	688008	澜起科技	14,334	833,092.08	0.05
25	300760	迈瑞医疗	2,600	821,522.00	0.05
26	688097	博众精工	30,303	816,362.82	0.05
27	300454	深信服	7,200	810,360.00	0.05
28	600760	中航沈飞	13,800	809,094.00	0.05
29	002493	荣盛石化	64,600	794,580.00	0.05
30	688668	鼎通科技	12,498	759,753.42	0.05
31	300982	苏文电能	16,571	748,014.94	0.05
32	600885	宏发股份	22,260	743,706.60	0.05
33	603799	华友钴业	11,960	665,334.80	0.04
34	600862	中航高科	29,000	646,410.00	0.04
35	000001	平安银行	48,300	635,628.00	0.04
36	300316	晶盛机电	9,400	597,464.00	0.04
37	603259	药明康德	7,300	591,300.00	0.04
38	300327	中颖电子	15,730	556,370.10	0.04
39	000739	普洛药业	25,500	549,270.00	0.04
40	600745	闻泰科技	8,400	441,672.00	0.03
41	300413	芒果超媒	11,400	342,228.00	0.02
42	688033	天宜上佳	11,644	234,626.60	0.02
43	600795	国电电力	24,000	102,480.00	0.01
44	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	001896	豫能控股	2,999,999.52	0.13
2	002617	露笑科技	2,999,997.36	0.13
3	688303	大全能源	2,999,987.54	0.13
4	300769	德方纳米	2,963,400.00	0.13
5	688099	晶晨股份	2,166,900.00	0.10
6	688083	中望软件	1,871,295.38	0.08
7	002487	大金重工	1,500,013.35	0.07

8	002053	云南能投	1,500,004.00	0.07
9	603982	泉峰汽车	1,500,001.36	0.07
10	601698	中国卫通	1,500,000.00	0.07
11	600328	中盐化工	1,499,999.04	0.07
12	000591	太阳能	1,499,997.72	0.07
13	600703	三安光电	1,499,997.00	0.07
14	002928	华夏航空	1,499,995.60	0.07
15	002108	沧州明珠	1,499,995.26	0.07
16	300496	中科创达	1,499,989.00	0.07
17	600938	中国海油	1,296,054.00	0.06
18	688008	澜起科技	774,179.34	0.03
19	688668	鼎通科技	750,004.98	0.03
20	300982	苏文电能	750,003.46	0.03

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。

8.4.2 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	688186	广大特材	6,408,448.25	0.29
2	300769	德方纳米	3,213,314.25	0.14
3	002520	日发精机	2,941,293.61	0.13
4	300850	新强联	2,900,175.80	0.13
5	300793	佳禾智能	1,953,786.90	0.09
6	600938	中国海油	1,915,088.71	0.09
7	688083	中望软件	1,908,666.24	0.09
8	002851	麦格米特	1,770,727.00	0.08
9	300383	光环新网	1,755,634.10	0.08
10	300451	创业慧康	1,640,093.40	0.07
11	601728	中国电信	1,639,085.76	0.07
12	002938	鹏鼎控股	1,383,928.00	0.06
13	688099	晶晨股份	1,363,840.63	0.06
14	002607	中公教育	1,201,265.00	0.05
15	002064	华峰化学	982,711.00	0.04
16	300413	芒果超媒	723,035.60	0.03
17	300768	迪普科技	652,453.92	0.03
18	002920	德赛西威	404,725.00	0.02
19	688148	芳源股份	331,093.60	0.01
20	300316	晶盛机电	286,449.00	0.01

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。

8.4.3 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	36,208,982.12
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	36,970,316.49
--------------	---------------

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。

8.5 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	11,343,817.21	0.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	71,165,665.76	4.61
	其中：政策性金融债	71,165,665.76	4.61
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）	13,581,368.21	0.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,090,851.18	6.23

8.6 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	200402	20农发02	600,000	61,012,520.55	3.95
2	019674	22国债09	112,000	11,343,817.21	0.74
3	220401	22农发01	100,000	10,153,145.21	0.66
4	113044	大秦转债	56,900	6,248,157.82	0.40
5	110059	浦发转债	15,220	1,597,022.09	0.10

8.7 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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.9 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。

8.10 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，故此项不适用。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，且作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为平衡型的目标风险策略基金，通过均衡配置于权益类和固定收益类资产来获取养老资金的长期稳健增值，在风控策略上将相对收益风险、子基金风格漂移风险及整体流动性风险进行重点控制。本基金主要投资于公开募集证券投资基金，整体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

8.12.2 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	003949	兴全稳泰债券A	契约型开放式	91,677,774.61	102,917,469.78	6.67	是
2	006985	兴全恒裕债券A	契约型开放式	53,983,625.25	58,410,282.52	3.79	是
3	040026	华安信用四季红债券A	契约型开放式	39,299,675.10	40,832,362.43	2.65	否
4	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	14,491,814.94	37,461,341.62	2.43	否

5	100032	富国中证红利指数增强 A	契约型开放式	39,217,483.20	35,609,474.75	2.31	否
6	003293	易方达科瑞灵活配置混合	契约型开放式	18,223,319.74	35,489,915.19	2.30	否
7	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	10,638,471.87	35,415,472.86	2.29	否
8	340009	兴全磐稳增利债券 A	契约型开放式	20,751,107.82	32,492,084.62	2.11	是
9	000191	富国信用债债券 A	契约型开放式	25,677,480.10	30,843,789.10	2.00	否
10	004681	万家安弘债券 A	契约型开放式	27,527,069.19	30,059,559.56	1.95	否
11	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	26,472,400.36	28,995,220.11	1.88	否
12	000082	嘉实研究阿尔法股票	契约型开放式	16,642,461.71	28,874,671.07	1.87	否
13	004027	广发景源纯债 A	契约型开放式	27,409,189.43	28,442,515.87	1.84	否
14	161017	富国中证 500 指数增强 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	12,761,581.62	27,616,062.63	1.79	否
15	163417	兴全合宜混合 (LOF) A	上市契约型开放式	17,930,334.00	27,334,794.18	1.77	是

			(LOF)				
16	163407	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	12,352,572.08	27,220,127.84	1.76	是
17	100058	富国产业债债券 A	契约 型开 放式	22,750,849.61	26,896,054.41	1.74	否
18	163415	兴全商业模式 优选混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	8,860,629.48	26,697,076.62	1.73	是
19	005937	工银精选金融 地产混合 A	契约 型开 放式	20,370,225.72	26,619,810.97	1.72	否
20	513500	博时标普 500ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	20,422,400.00	25,630,112.00	1.66	否
21	110023	易方达医疗保 健行业混合	契约 型开 放式	8,103,962.59	24,790,021.56	1.61	否
22	002650	东方红稳添利 纯债债券 A	契约 型开 放式	21,952,806.27	23,926,363.55	1.55	否
23	003327	万家鑫璟纯债 债券 A	契约 型开 放式	19,447,112.00	23,212,072.88	1.50	否
24	519773	交银数据产业 灵活配置混合	契约 型开 放式	12,685,660.84	23,070,142.80	1.49	否
25	166001	中欧新趋势混 合 (LOF) A	上市 契约 型开	18,354,888.32	22,578,348.12	1.46	否

			放式 (LOF)				
26	000471	富国城镇发展 股票	契约 型开 放式	9,491,952.13	22,002,345.04	1.43	否
27	166019	中欧价值智选 混合 A	契约 型开 放式	4,696,456.23	21,393,297.42	1.39	否
28	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	18,903,600.00	21,209,839.20	1.37	否
29	004958	圆信永丰优享 生活混合	契约 型开 放式	10,184,053.03	21,055,529.64	1.36	否
30	163412	兴全轻资产混 合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	6,590,482.61	20,213,010.16	1.31	是
31	005709	华安鼎益债券 A	契约 型开 放式	18,474,826.79	19,710,792.70	1.28	否
32	166009	中欧新动力混 合 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	6,703,372.55	19,492,737.04	1.26	否
33	007449	兴全多维价值 混合 A	契约 型开 放式	10,061,587.70	18,504,265.94	1.20	是
34	161039	富国中证 1000 指数增 强 (LOF) A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	10,015,524.84	18,287,346.81	1.19	否

35	005623	广发中债 1-3 年农发债指数 A	契约型开放式	17,098,793.58	18,063,165.54	1.17	否
36	501025	鹏华香港银行指数 (LOF) A	上市契约型开放式 (LOF)	18,014,209.92	17,907,926.08	1.16	否
37	518880	华安黄金易 (ETF)	交易型开放式 (ETF)	4,482,700.00	17,868,042.20	1.16	否
38	163409	兴全绿色投资混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	9,724,050.53	16,880,951.72	1.09	是
39	510900	易方达恒生国企 (QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	20,301,600.00	16,403,692.80	1.06	否
40	169106	东证创优	上市契约型开放式 (LOF)	16,423,861.00	15,881,873.59	1.03	否
41	519671	银河沪深 300 价值指数 A	契约型开放式	10,344,137.93	15,226,571.03	0.99	否
42	000186	华泰柏瑞季季红债券	契约型开放式	14,294,251.63	15,120,459.37	0.98	否
43	070019	嘉实价值优势混合	契约型开放式	6,657,663.54	14,966,427.64	0.97	否
44	260112	景顺长城能源基建混合	契约型开	7,305,789.47	13,610,685.78	0.88	否

			放式				
45	006567	中泰星元灵活配置混合 A	契约型开放式	5,479,495.84	13,238,461.95	0.86	否
46	004388	鹏华丰享债券	契约型开放式	9,422,846.75	10,717,545.89	0.69	否
47	003280	鹏华丰恒债券	契约型开放式	9,665,294.32	10,550,635.28	0.68	否
48	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	9,896,216.69	10,036,742.97	0.65	否
49	009306	平安惠铭纯债债券	契约型开放式	9,338,750.35	9,999,933.87	0.65	否
50	002169	永赢稳益债券	契约型开放式	9,139,293.54	9,926,186.71	0.64	否
51	006884	添富 AAA 级信用纯债 A	契约型开放式	8,814,706.05	9,910,374.01	0.64	否
52	007147	博时中债 1-3 年国开行债券指数 A	契约型开放式	9,856,299.78	9,905,581.28	0.64	否
53	002980	华夏创新前沿股票	契约型开放式	4,288,121.78	9,832,663.24	0.64	否
54	007321	鹏华金利债券	契约型开放式	9,560,133.76	9,803,917.17	0.64	否
55	110037	易方达纯债债券 A	契约型开放式	8,951,577.49	9,782,283.88	0.63	否
56	006682	景顺长城中证 500 指数增强	契约型开	6,889,014.16	9,454,483.03	0.61	否

			放式				
57	270021	广发聚瑞混合 A	契约型开放式	2,371,456.76	9,076,750.75	0.59	否
58	006925	永赢中债-1-3 年政金债指数	契约型开放式	8,545,274.71	9,023,810.09	0.58	否
59	512170	华宝中证医疗 ETF	交易型开放式 (ETF)	15,543,500.00	7,896,098.00	0.51	否
60	000205	易方达投资级信用债债券 A	契约型开放式	6,091,340.44	6,931,945.42	0.45	否
61	001857	易方达现代服务业混合	契约型开放式	3,434,656.17	5,808,003.58	0.38	否
62	512090	易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易型开放式 (ETF)	3,806,900.00	5,638,018.90	0.37	否
63	006002	工银医药健康股票 A	契约型开放式	2,423,023.15	5,172,912.12	0.34	否
64	003376	广发中债 7-10 年国开债指数 A	契约型开放式	4,104,269.29	5,117,202.95	0.33	否
65	009686	华夏磐利一年定开混合 A	契约型开放式	2,975,241.04	4,639,888.40	0.30	否
66	510050	华夏上证 50ETF	交易型开放式 (ETF)	1,522,000.00	4,031,778.00	0.26	否
67	512800	华宝中证银行 ETF	交易型开	1,981,500.00	2,136,057.00	0.14	否

			放式 (ETF)				
68	513090	易方达中证香港证券投资主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,772,300.00	1,905,222.50	0.12	否
69	515450	南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF	交易型开放式 (ETF)	1,622,600.00	1,854,631.80	0.12	否
70	184801	鹏华前海	上市契约型开放式 (LOF)	18,800.00	1,793,896.00	0.12	否
71	159941	纳指 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,496,100.00	1,497,660.00	0.10	否
72	513100	国泰纳斯达克 100(QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	1,284,500.00	1,026,315.50	0.07	否
73	510170	国联安商品 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,155,600.00	937,191.60	0.06	否
74	512720	国泰中证计算机主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	878,400.00	931,104.00	0.06	否
75	501025	鹏华香港银行指数(LOF)A	上市契约型开放式 (LOF)	810,137.00	802,845.77	0.05	否

76	515180	易方达中证红利 ETF	交易型开放式 (ETF)	392,600.00	477,009.00	0.03	否
77	506000	南方科创板 3 年定开混合	上市契约型开放式 (LOF)	182,300.00	145,657.70	0.01	否
78	161014	富国汇利	上市契约型开放式 (LOF)	9,300.00	11,485.50	0.00	否
79	001821	兴全天添益货币 B	契约型开放式	1,264.26	1,264.26	0.00	是
80	511990	华宝添益货币 A	交易型开放式 (ETF)	11.00	1,100.15	0.00	否

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 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。

8.13.3 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	9,028.35
2	应收清算款	112,639.50
3	应收股利	92,374.13
4	应收利息	-
5	应收申购款	799,550.74

6	其他应收款	37.57
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,013,630.29

8.13.4 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	6,248,157.82	0.40
2	110059	浦发转债	1,597,022.09	0.10
3	128129	青农转债	1,192,997.75	0.08
4	113037	紫银转债	937,589.56	0.06
5	113042	上银转债	461,990.84	0.03
6	127030	盛虹转债	455,746.00	0.03
7	128063	未来转债	368,474.61	0.02
8	113043	财通转债	323,245.71	0.02
9	123107	温氏转债	316,546.63	0.02
10	110067	华安转债	308,473.72	0.02
11	113052	兴业转债	304,425.01	0.02
12	110081	闻泰转债	268,219.87	0.02
13	110085	通22转债	152,558.50	0.01
14	127061	美锦转债	152,278.31	0.01
15	127033	中装转2	52,898.37	0.00

8.13.5 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	002617	露笑科技	3,369,400.02	0.22	非公开发行流通受限
2	001896	豫能控股	3,202,868.34	0.21	非公开发行流通受限
3	688303	大全能源	2,723,680.52	0.18	非公开发行流通受限
4	002928	华夏航空	2,124,450.29	0.14	非公开发行流通受限
5	688099	晶晨股份	1,987,500.00	0.13	大宗交易购入流通受限
6	601698	中国卫通	1,701,562.50	0.11	非公开发行流通受限
7	600328	中盐化工	1,659,471.36	0.11	非公开发行流通受限

8.13.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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(%)
兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	75,124	13,672.31	15,904,089.21	1.55	1,011,214,854.03	98.45
兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y	2	4,331.32	-	-	8,662.63	100.00
合计	75,126	13,672.07	15,904,089.21	1.55	1,011,223,516.66	98.45

9.2 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	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	10,394,523.07	1.0120
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y	0.00	0.0000
	合计	10,394,523.07	1.0120

注：“占基金总份额比例”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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	>100
	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y	0
	合计	>100

本基金基金经理持有本 开放式基金	兴全安泰平衡养老三年持有 混合 FOF A	>100
	兴全安泰平衡养老三年持有 混合 FOF Y	0
	合计	>100

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

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF A	兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y
基金合同生效日 (2019年1月25 日)基金份额总额	628,976,962.65	-
本报告期期初基金 份额总额	1,367,579,704.12	-
本报告期基金总申 购份额	146,364,282.61	8,662.63
减：本报告期基金 总赎回份额	486,825,043.49	-
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	1,027,118,943.24	8,662.63

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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) 报告期内本基金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) 报告期内托管人的专门基金托管部门重大人事变动。

2022 年 7 月 15 日起, 孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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, 该基金自 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”, 场内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开放后更名而来。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，二级市场交易和跨系统转托管业务仍照常办理，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、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年处于封闭运作期，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，该基金 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“501080”。

9、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 7 日起，该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。

10、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 501086，场内简称仍为“科创财通”。

11、报告期内，易方达信用债债券型证券投资基金修改了基金投资范围、投资策略、投资限制、基金估值等内容并调整了该基金的业绩比较基准，业绩比较基准从“中债-信用债总指数”调整为“中债-优选投资级信用债财富指数”。

12、报告期内，鹏扬中证 500 质量成长指数证券投资基金转型为鹏扬中证 500 质量成长交易型开放式指数证券投资基金联接基金并修订基金合同，并对基金合同进行了其他必要修改和补充，相应修改了基金的托管协议、招募说明书及产品资料概要。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2019 年起连续 4 年聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 5.0 万元人民币。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	4	42,205,731.49	100.00	31,643.99	100.00	新增1个
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	4	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	注

中信建投 证券	5	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本报告期内本基金减少中泰证券 2 个交易单元。

11.8.2 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	45,493,820.91	100.00	2,288,700,000.00	100.00	-	-	105,046,341.45	100.00
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证	-	-	-	-	-	-	-	-

券								
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

11.9 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	中国证券报、规定互联网站	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	中国证券报、规定互联网站	2022-01-06
3	关于增加旗下部分基金销售机构的	中国证券报、规定互联	2022-01-19

	公告	网网站	
4	兴全安泰平衡养老目标三年持有期 混合型基金中基金(FOF)开放日常赎回、 转换转出业务的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-01-20
5	关于副总经理离任的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-01-21
6	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	中国证券报、规定互联 网网站	2022-01-26
7	关于使用固有资金自购旗下偏股型 公募基金壹亿元的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-01-27
8	关于公司副总经理任职的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-01-28
9	关于增加旗下部分基金销售机构的 公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-02-16
10	关于增加华夏银行为旗下部分基金 销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-02-23
11	关于增加德邦证券为旗下部分基金 销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-03-15
12	关于增加财达证券为旗下部分基金 销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-04-11
13	关于增加兴业银行为旗下部分基金 销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-05-06
14	关于调整网上直销基金转换、赎回 转购、汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-06-17
15	关于公司副总经理变更的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-06-30
16	关于增加中银国际证券股份有限公 司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-07-04
17	关于增加中国银行为兴全安泰平衡 养老目标三年持有期混合型基金中 基金(FOF)的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-07-06
18	关于旗下部分基金投资豫能控股 (001896)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-07-07
19	关于增加国泰君安证券股份有限公 司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-07-15
20	关于旗下部分基金投资露笑科技 (002617)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-07-23
21	关于旗下部分基金投资沧州明珠 (002108)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-08-11
22	关于旗下部分基金投资太阳能 (000591)非公开发行股票的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-08-18
23	关于增加平安证券为旗下部分基金 销售机构的公告	中国证券报、规定互联 网网站	2022-09-06
24	关于增加国新证券为旗下部分基金	中国证券报、规定互联	2022-09-13

	销售机构的公告	网网站	
25	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-09-16
26	关于旗下部分基金投资云南能投(002053)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-09-21
27	关于增加九州证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-09-27
28	关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-09-27
29	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-09-28
30	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资中科创达(300496)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-09-29
31	关于使用自有资金自购旗下权益类公募基金五千万的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-18
32	关于关闭网上直销汇款交易的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-24
33	关于旗下部分基金投资中国卫通(601698)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-10-27
34	关于旗下部分基金投资天宜上佳(688033)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-01
35	关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-09
36	关于增加渤海证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-16
37	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-17
38	关于增加中泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-18
39	关于我司网上直销平台汇通宝相关业务停止办理的通知	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-30
40	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资中盐化工(600328)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-11-30
41	关于旗下部分基金投资华夏航空(002928)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-03
42	关于调整网上直销部分基金转换赎回转购优惠费率公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-06
43	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资博众精工(688097)非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-15
44	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资泉峰汽车	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-15

	(603982) 非公开发行的公告		
45	关于旗下部分基金投三安光电 (600703) 非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-16
46	关于我司网上交易系统暂停服务的通知	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-16
47	关于旗下部分基金投资鼎通科技 (688668) 非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-22
48	兴证全球基金管理有限公司关于兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金增加 Y 类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-24
49	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 基金合同	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-24
50	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 托管协议	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-24
51	关于旗下部分基金投资苏文电能 (300982) 非公开发行的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-27
52	关于增加旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-28
53	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) (兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF Y 类份额) 基金产品资料概要更新	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-28
54	兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF) 更新招募说明书 (20221228 更新)	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-28
55	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额发售的提示性公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-28
56	关于增加旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-29
57	关于增加民生银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网网站	2022-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

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

产品特有风险

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

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金为养老目标基金，致力于满足投资者的养老资金理财需求，但养老目标基金并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺。本基金非保本产品，存在投资者承担亏损的可能性。

2、本基金每份基金份额的最短持有期限为 3 年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 年（3 年指 365 天乘以 3 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后，3 年内无法赎回的风险。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会关于准予兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复文件

2、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同

3、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 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中心电话：400-678-0099，021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日