

# 兴全合远两年持有期混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	17
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	52

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	52
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	52
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	54
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合远两年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	兴全合远两年持有混合	
基金主代码	011338	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 27 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	4,078,794,424.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全合远两年持有混合 A	兴全合远两年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	011338	011339
报告期末下属分级基金的份额总额	3,895,897,849.15 份	182,896,575.04 份

注：本基金每份基金份额最短持有期为 2 年。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过深入的基本面研究挖掘具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，力求实现资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及其他品种的投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	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		021-20398858	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)		
	兴全合远两年持有混合 A	兴全合远两年持有混合 C	
本期已实现收益	-428,871,870.29	-20,431,470.78	
本期利润	-549,499,461.20	-25,917,284.54	
加权平均基金份额本期利润	-0.1413	-0.1425	
本期加权平均净值利润率	-16.10%	-16.33%	
本期基金份额净值增长率	-13.54%	-13.79%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)		
	期末可供分配利润	-367,000,992.31	-18,394,533.65
	期末可供分配基金份额利润	-0.0942	-0.1006

期末基金资产净值	3,528,896,856.84	164,502,041.39
期末基金份额净值	0.9058	0.8994
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-9.42%	-10.06%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全合远两年持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.97%	1.66%	6.26%	0.91%	2.71%	0.75%
过去三个月	7.17%	1.79%	4.91%	1.14%	2.26%	0.65%
过去六个月	-13.54%	1.72%	-5.63%	1.21%	-7.91%	0.51%
过去一年	-12.34%	1.37%	-12.36%	1.02%	0.02%	0.35%
自基金合同生效起至今	-9.42%	1.27%	-10.92%	0.97%	1.50%	0.30%

兴全合远两年持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	8.93%	1.66%	6.26%	0.91%	2.67%	0.75%
过去三个月	7.01%	1.79%	4.91%	1.14%	2.10%	0.65%
过去六个月	-13.79%	1.72%	-5.63%	1.21%	-8.16%	0.51%
过去一年	-12.87%	1.37%	-12.36%	1.02%	-0.51%	0.35%
自基金合同生效起至今	-10.06%	1.27%	-10.92%	0.97%	0.86%	0.30%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%

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：

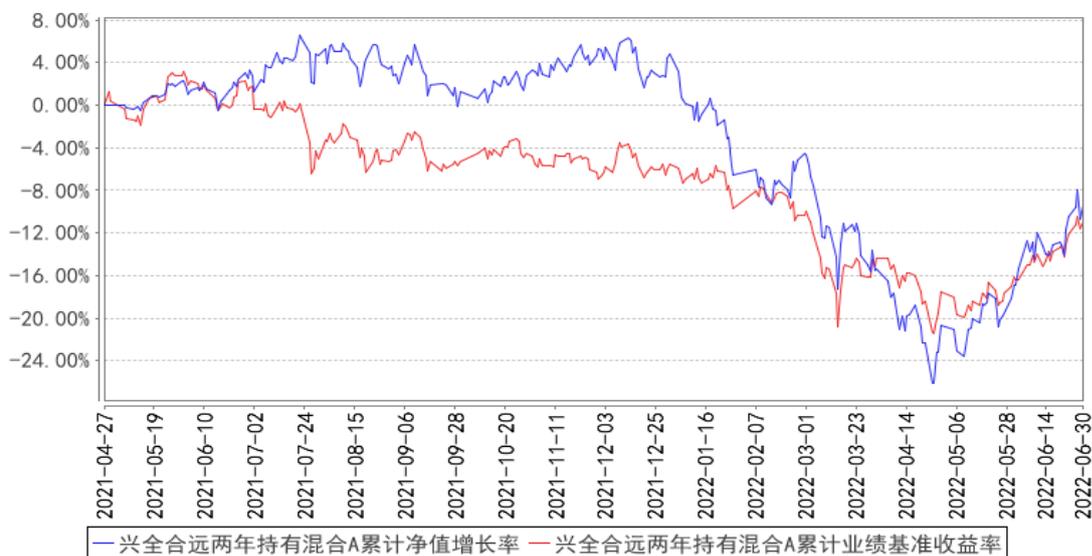
$$\text{Return}_t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

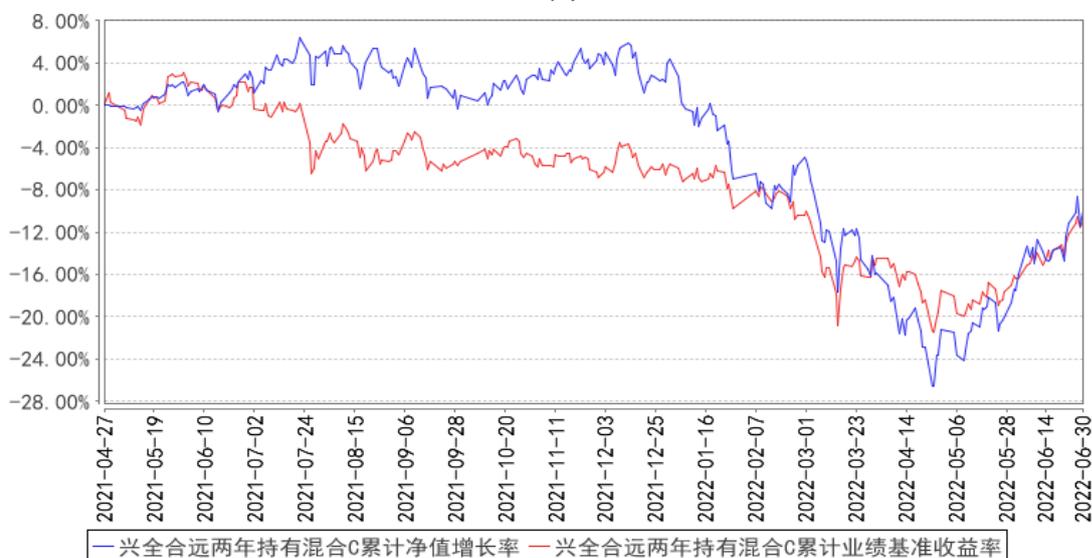
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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

兴全合远两年持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全合远两年持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全合远两年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的建仓期为 2021 年 4 月 27 日到 2021 年 10 月 26 日。建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王品	基金管理部总监助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、兴全合远两年持有期混合型证券投资基金基金经理	2021年4月27日	-	23年	硕士，历任兴业证券研发中心医药行业研究员、研究报告内核组组长，中银国际基金管理公司医药、化工、石化行业研究员，汇丰晋信基金管理有限公司医药、房地产行业高级研究员、基金经理、投资副总监，兴证全球基金管理有限公司专户投资部总监助理兼投资经理。

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，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全合远两年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在非公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，国内外经济环境的变化出人意料，先有俄乌战争致大宗商品价格暴涨，通货膨胀率节节攀升，拖累全球经济陷入衰退的泥沼中；后有国内疫情爆发致部分经济重镇发展严重受损，国内经济增长大幅度减缓，上半年前两季 GDP 增长率分别为 4.8%、0.4%。考虑到疫情对国内经济造成的影响，国内二季度产业政策与市场流动性层面取向宽松。二季度出台了房地产与汽车产业刺激政策以提振经济增长，同时也对前期的监管政策（如互联网行业）进行了部分的调整；二季度市场的货币供应量较为充足，信用环境保持宽松，但宽信用的基础还有待进一步稳固。受经济增长表现不佳的影响，上半年 A 股市场震荡剧烈，沪深 300 指数跌幅达到 9.22%，期间振幅

高达 24.38%，创业板指数跌幅为 15.41%，期间振幅达到 36.93%。在板块表现方面，稳增长与资源类板块如煤炭、地产等行业表现较佳，而去年的成长板块如电子、军工等板块表现则较弱。

2022 年一季度，本基金的组合结构与去年底基本类似，保持了在电子与军工领域的超额配置；但进入二季度以后，我们对组合结构进行了调整，增持了新能源汽车产业链，主要原因是新能源汽车销量数据持续超出市场预期，并且我们相信，未来新能源车的渗透率仍将不断提升；增持了创新药板块，创新药板块的大幅度下跌已使优秀公司的价值凸显；减持了电子产业链相关公司，主要理由是消费电子需求下行等。我们仍将不断观察主要经济指标以优化我们的组合结构。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全合远两年持有混合 A 的基金份额净值为 0.9058 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.54%，同期业绩比较基准收益率为-5.63%；截至本报告期末兴全合远两年持有混合 C 的基金份额净值为 0.8994 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.79%，同期业绩比较基准收益率为-5.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年下半年，考虑到全球经济均处于衰退中，而国内疫情仍有反复并不时扰动经济增长的节奏，我们预计下半年国内经济增长回暖的力度偏弱，而在货币政策、产业政策、财政政策方面将继续保持宽松、积极、稳健的取向，预计 2022 年下半年，市场将维持震荡的局面，但对个股仍将保持一定的投资活跃度，投资者的热情将由新能源板块扩散开来。

下半年，我们的组合配置坚持于两个方向，一方面由于看好国内工程师红利对我国制造业高质量发展的推动作用，本基金仍将遵循着自下而上的选股原则，配置于产业结构上升、基本面发展趋势良好的公司；另一方面，我们也将关注一些估值相对较低、短期基本面低迷，但中长期仍存在发展空间的个股与板块。在港股市场方面，港股市场已低迷了较长的时间，我们也将积极关注其中蕴含的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重

大事件等可能对估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全合远两年持有期混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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遵规守信、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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：兴全合远两年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	198,260,546.08	259,492,232.48
结算备付金		2,809,360.97	6,314,540.27
存出保证金		1,285,891.23	1,283,320.37
交易性金融资产	6.4.7.2	3,518,087,299.53	3,965,030,402.75
其中：股票投资		3,326,077,672.13	3,720,832,572.95
基金投资		-	-
债券投资		192,009,627.40	244,197,829.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		89,927,462.91	39,018,235.34
应收股利		4,951,399.19	-
应收申购款		100,635.89	80,275.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	5,643,563.76
资产总计		3,815,422,595.80	4,276,862,570.93
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		114,336,376.49	14,849,423.39
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		4,369,413.69	5,389,388.11
应付托管费		728,235.65	898,231.35
应付销售服务费		77,851.05	95,400.22
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,511,820.69	3,039,615.07
负债合计		122,023,697.57	24,272,058.14
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	4,078,794,424.19	4,060,233,711.18
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-385,395,525.96	192,356,801.61
净资产合计		3,693,398,898.23	4,252,590,512.79
负债和净资产总计		3,815,422,595.80	4,276,862,570.93

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，兴全合远两年持有混合 A 基金份额净值 0.9058 元，基金份额总额 3,895,897,849.15 份；兴全合远两年持有混合 C 基金份额净值 0.8994 元，基金份额总额 182,896,575.04 份。兴全合远两年持有混合份额总额合计为 4,078,794,424.19 份。

2、本基金合同生效日为 2021 年 4 月 27 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日。

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

## 6.2 利润表

会计主体：兴全合远两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 4 月 27 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-543,761,619.79	149,503,887.59
1. 利息收入		461,524.38	4,975,287.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	461,524.38	1,250,219.98
债券利息收入		-	577,085.15

资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			3,147,982.63
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-418,109,739.50	7,242,616.39
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-436,138,731.35	1,558,497.23
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.15	1,398,037.63	-
资产支持证券投资	6.4.7.16		-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17		-
衍生工具收益	6.4.7.18		-
股利收益	6.4.7.19	16,630,954.22	5,684,119.16
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益			-
其他投资收益			-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-126,113,404.67	137,285,983.44
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21		-
<b>减：二、营业总支出</b>		31,655,125.95	15,248,769.32
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,629,009.66	10,707,617.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,438,168.34	1,784,602.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	473,399.75	187,329.59
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1		-
5. 利息支出			-
其中：卖出回购金融资产支出			-
6. 信用减值损失	6.4.7.22		-
7. 税金及附加			1.39
8. 其他费用	6.4.7.23	114,548.20	2,569,218.46
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-575,416,745.74	134,255,118.27
减：所得税费用			-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-575,416,745.74	134,255,118.27
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>			-

六、综合收益总额		-575,416,745.74	134,255,118.27
----------	--	-----------------	----------------

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

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全合远两年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,060,233,711.18	-	192,356,801.61	4,252,590,512.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	4,060,233,711.18	-	192,356,801.61	4,252,590,512.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	18,560,713.01	-	-577,752,327.57	-559,191,614.56
（一）、综合收益总额	-	-	-575,416,745.74	-575,416,745.74
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	18,560,713.01	-	-2,335,581.83	16,225,131.18

号填列)				
其中：1. 基金申购款	18,560,713.01	-	-2,335,581.83	16,225,131.18
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)	4,078,794,424.19	-	-385,395,525.96	3,693,398,898.23
项目	上年度可比期间			
	2021年4月27日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	4,032,089,616.62	-	-	4,032,089,616.62
三、本期增减变动额(减少	-	-	134,255,118.27	134,255,118.27

以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	134,255,118.27	134,255,118.27
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
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)	4,032,089,616.62	-	134,255,118.27	4,166,344,734.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉

基金管理人负责人

庄园芳

主管会计工作负责人

詹鸿飞

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴全合远两年持有期混合型证券投资基金(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》、《兴全合远两年持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020] 3718 号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金根据是否收取认购费、申购费、销售服务费的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 4,032,089,616.62 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(21)第 00188 号验资报告。基金合同于 2021 年 4 月 27 日生效。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 60%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算) $\times$ 20%+中债综合(全价)指数收益率 $\times$ 20%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

##### 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

##### (2) 金融负债分类

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

##### 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债)，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际

利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

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

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

本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应付交易费用和其他负债，金额分别为人民币 259,492,232.48 元、人民币 6,314,540.27 元、人民币 1,283,320.37 元、人民币 5,643,563.76 元、人民币 2,899,615.07 元和人民币 140,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金等项目中，不单独列示应收利息

项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、其他负债的金额分别为人民币 259,521,983.92 元、人民币 6,319,180.36 元、人民币 1,284,757.95 元、人民币 3,039,615.07 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 3,965,030,402.75 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 5,607,734.65 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 3,970,638,137.40 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	198,260,546.08
等于：本金	198,252,091.48
加：应计利息	8,454.60
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	198,260,546.08
----	----------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,336,343,222.40	-	3,326,077,672.13	10,265,550.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	189,732,670.00	1,838,627.40	192,009,627.40
	合计	189,732,670.00	1,838,627.40	192,009,627.40
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,526,075,892.40	1,838,627.40	3,518,087,299.53	-9,827,220.27

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本报告期末本基金无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,422,560.54
其中：交易所市场	2,422,310.54
银行间市场	250.00
应付利息	-
预提信息披露费	59,507.37
预提审计费用	29,752.78
合计	2,511,820.69

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 兴全合远两年持有混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,879,688,821.47	3,879,688,821.47
本期申购	16,209,027.68	16,209,027.68
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	3,895,897,849.15	3,895,897,849.15

## 兴全合远两年持有混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	180,544,889.71	180,544,889.71
本期申购	2,351,685.33	2,351,685.33
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	182,896,575.04	182,896,575.04

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 兴全合远两年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	72,703,346.77	111,834,951.84	184,538,298.61
本期利润	-428,871,870.29	-120,627,590.91	-549,499,461.20
本期基金份额交易产生的变动数	-451,815.36	-1,588,014.36	-2,039,829.72
其中：基金申购款	-451,815.36	-1,588,014.36	-2,039,829.72
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-356,620,338.88	-10,380,653.43	-367,000,992.31
-----	-----------------	----------------	-----------------

兴全合远两年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,623,746.85	5,194,756.15	7,818,503.00
本期利润	-20,431,470.78	-5,485,813.76	-25,917,284.54
本期基金份额交易产生的变动数	-65,218.47	-230,533.64	-295,752.11
其中：基金申购款	-65,218.47	-230,533.64	-295,752.11
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,872,942.40	-521,591.25	-18,394,533.65

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	349,781.76
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	97,534.62
其他	14,208.00
合计	461,524.38

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-436,138,731.35
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	-436,138,731.35

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	3,250,918,994.36
减：卖出股票成本总额	3,677,641,731.93
减：交易费用	9,415,993.78

买卖股票差价收入	-436,138,731.35
----------	-----------------

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,783,505.23
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-385,467.60
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	1,398,037.63

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	290,352,798.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	284,536,342.60
减：应计利息总额	6,200,798.78
减：交易费用	1,125.00
买卖债券差价收入	-385,467.60

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

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

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,630,954.22
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	16,630,954.22

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-126,113,404.67
股票投资	-126,946,527.47
债券投资	833,122.80
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-126,113,404.67

#### 6.4.7.21 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
银行费用	16,288.05
合计	114,548.20

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年4月27日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）
兴业证券	700,294,012.55	10.53	337,614,313.97	13.82

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年4月27日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）
兴业证券	-	-	1,822,300,000.00	17.76

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	658,956.65	14.18	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年4月27日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	315,530.22	17.49	315,530.22	17.49

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和买（卖）证管费等）。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年4月27日（基金 合同生效日）至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	26,629,009.66	10,707,617.02
其中：支付销售机构的客户维护 费	10,686,393.44	4,302,300.24

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年4月27日（基金 合同生效日）至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,438,168.34	1,784,602.86

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

	本期

获得销售服务费的各关联方名称	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合远两年持有混合 A	兴全合远两年持有混合 C	合计
兴业证券		18,595.11	18,595.11
兴证全球基金		15,417.39	15,417.39
招商银行		79,655.48	79,655.48
合计		113,667.98	113,667.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合远两年持有混合 A	兴全合远两年持有混合 C	合计
兴证全球基金		6,865.53	6,865.53
招商银行		31,832.88	31,832.88
兴业证券		7,503.80	7,503.80
合计		46,202.21	46,202.21

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：兴全合远两年持有混合 C 日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.6%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期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。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金管理人于本报告期内和上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

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。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年4月27日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	198,260,546.08	349,781.76	1,786,310,753.52	1,174,834.50

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

## 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	390	16,575.00	12,487.80	-
301103	何氏眼科	2022年6月1日	3-4个月	新股流通受限-转增	-	32.02	117	-	3,746.34	-

301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新股流通受限	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股流通受限	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股流通受限	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
600938	中国海油	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
601778	晶科科技	2022年1月10日	6个月	大宗交易购入流通受限	7.00	5.33	2,800,000	19,600,000.00	14,924,000.00	-
688052	纳芯微	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	230.00	350.81	6,090	1,400,700.00	2,136,432.90	-
688326	经纬恒润	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	121.00	134.07	6,832	826,672.00	915,966.24	-

		日								
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新股流通受限	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

注：本基金持有的新股流通受限股票何氏眼科，于 2022 年 6 月 1 日实施 2021 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 6 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股。本基金新增 117 股。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好

信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

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

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

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债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

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

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测

基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。

本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	198,260,546.08	-	-	-	-	-	198,260,546.08
结算备付金	2,809,360.97	-	-	-	-	-	2,809,360.97
存出保证金	1,285,891.23	-	-	-	-	-	1,285,891.23
交易性金融资产	-	-	192,009,627.40	-	-	3,326,077,672.13	3,518,087,299.53
应收股利	-	-	-	-	-	4,951,399.19	4,951,399.19
应收申购款	28,366.52	-	-	-	-	72,269.37	100,635.89

应收清算款	-	-	-	-	-	89,927,462.91	89,927,462.91
资产总计	202,384,164.80	-	192,009,627.40	-	-	3,421,028,803.60	3,815,422,595.80
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,369,413.69	4,369,413.69
应付托管费	-	-	-	-	-	728,235.65	728,235.65
应付清算款	-	-	-	-	-	114,336,376.49	114,336,376.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	77,851.05	77,851.05
其他负债	-	-	-	-	-	2,511,820.69	2,511,820.69
负债总计	-	-	-	-	-	122,023,697.57	122,023,697.57
利率敏感度缺口	202,384,164.80	-	192,009,627.40	-	-	3,299,005,106.03	3,693,398,898.23
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	259,492,232.48	-	-	-	-	-	259,492,232.48
结算备付金	6,314,540.27	-	-	-	-	-	6,314,540.27
存出保证金	1,283,320.37	-	-	-	-	-	1,283,320.37
交易性金融资产	244,197,829.80	-	-	-	-	3,720,832,572.95	3,965,030,402.75
应收申购款	1,279.52	-	-	-	-	78,996.44	80,275.96
应收证券清算款	-	-	-	-	-	39,018,235.34	39,018,235.34
其他资产	-	-	-	-	-	5,643,563.76	5,643,563.76
资产总计	511,289,202.44	-	-	-	-	3,765,573,368.49	4,276,862,570.93
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,389,388.11	5,389,388.11
应付托管费	-	-	-	-	-	898,231.35	898,231.35
应付证券清	-	-	-	-	-	14,849,42	14,849,423

算款						3.39	.39
应付销售服务费						95,400.22	95,400.22
其他负债						3,039,615.07	3,039,615.07
负债总计						24,272,058.14	24,272,058.14
利率敏感度缺口	511,289,202.44					3,741,301,310.35	4,252,590,512.79

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	1. 市场利率+1%	-1,010,466.00	-140,333.17
	2. 市场利率-1%	1,021,320.96	140,494.34

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			合计
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				

交易性金融资产	-	592,831,295.57	-	592,831,295.57
资产合计	-	592,831,295.57	-	592,831,295.57
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	592,831,295.57	-	592,831,295.57
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	416,737,275.84	-	416,737,275.84
资产合计	-	416,737,275.84	-	416,737,275.84
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	416,737,275.84	-	416,737,275.84

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	29,641,564.78	20,836,863.79
	所有外币相对人民币贬值 5%	-29,641,564.78	-20,836,863.79

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,326,077,672.13	90.05	3,720,832,572.95	87.50
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	192,009,627.40	5.20	244,197,829.80	5.74
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,518,087,299.53	95.25	3,965,030,402.75	93.24

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)		
	本期末 (2022年6月30日)	上年度末 (2021年12月31日)	
分析	1. 业绩比较基准上升 10%	503,866,921.64	343,625,776.01
	2. 业绩比较基准下降 10%	-503,866,921.64	-343,625,776.01

	降 10%		
--	-------	--	--

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,306,040,713.92	3,596,294,101.22
第二层次	192,555,973.70	244,197,829.80
第三层次	19,490,611.91	124,538,471.73
合计	3,518,087,299.53	3,965,030,402.75

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

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,326,077,672.13	87.17
	其中:股票	3,326,077,672.13	87.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	192,009,627.40	5.03
	其中:债券	192,009,627.40	5.03
	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	201,069,907.05	5.27
8	其他各项资产	96,265,389.22	2.52
9	合计	3,815,422,595.80	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 592,831,295.57 元,占净值比例 16.05%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	95,708,885.99	2.59
C	制造业	2,014,387,151.48	54.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	92,780,818.68	2.51
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	112,151,156.88	3.04
G	交通运输、仓储和邮政业	84,062,500.25	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	249,901,958.38	6.77
J	金融业	14,440,535.00	0.39
K	房地产业	36,994,248.00	1.00
L	租赁和商务服务业	32,609,501.21	0.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	209,620.69	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,733,246,376.56	74.00

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	176,985,333.34	4.79
日常消费品	-	-
能源	56,543,041.93	1.53
金融	39,383,309.08	1.07
医疗保健	233,768,189.57	6.33
工业	14,944,445.25	0.40
信息技术	71,206,976.40	1.93
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	592,831,295.57	16.05

注：以上分类采用全球行业分类标准(Global Industry Classification Standard, GICS)。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002049	紫光国微	1,555,070	295,027,880.40	7.99
2	300496	中科创达	1,450,001	189,196,130.48	5.12

3	002594	比亚迪	315,656	105,268,119.44	2.85
3	01211	比亚迪股份	287,000	77,068,012.42	2.09
4	01801	信达生物	5,961,000	177,912,786.89	4.82
5	688008	澜起科技	2,899,119	175,628,629.02	4.76
6	300750	宁德时代	243,556	130,058,904.00	3.52
7	000963	华东医药	2,483,418	112,151,156.88	3.04
8	603267	鸿远电子	779,817	104,752,817.61	2.84
9	600745	闻泰科技	1,178,421	100,295,411.31	2.72
10	002353	杰瑞股份	2,427,038	97,809,631.40	2.65
11	300274	阳光电源	942,300	92,580,975.00	2.51
12	600309	万华化学	882,734	85,616,370.66	2.32
13	00883	中国海洋石油	6,382,000	56,543,041.93	1.53
13	600938	中国海油	1,136,904	19,705,408.44	0.53
14	601012	隆基绿能	1,141,176	76,036,556.88	2.06
15	603899	晨光股份	1,311,258	73,535,348.64	1.99
16	300327	中颖电子	1,475,589	73,499,088.09	1.99
17	601021	春秋航空	1,214,115	70,843,610.25	1.92
18	000063	中兴通讯	2,647,900	67,600,887.00	1.83
19	300724	捷佳伟创	754,739	67,435,929.65	1.83
20	600399	抚顺特钢	3,727,800	66,727,620.00	1.81
21	02331	李宁	1,029,000	63,975,310.08	1.73
22	600161	天坛生物	2,596,970	63,054,431.60	1.71
23	688100	威胜信息	2,989,209	62,743,496.91	1.70
24	688099	晶晨股份	579,895	58,569,395.00	1.59
25	02382	舜宇光学科技	518,427	56,704,923.67	1.54
26	06078	海吉亚医疗	1,252,415	55,855,402.68	1.51
27	600519	贵州茅台	26,500	54,192,500.00	1.47
28	600025	华能水电	7,058,332	49,337,740.68	1.34
29	600438	通威股份	782,200	46,822,492.00	1.27
30	002192	融捷股份	258,800	39,777,560.00	1.08
31	00388	香港交易所	119,306	39,383,309.08	1.07
32	600048	保利发展	2,118,800	36,994,248.00	1.00
33	601899	紫金矿业	3,882,735	36,225,917.55	0.98
34	03998	波司登	8,630,000	35,942,010.84	0.97
35	300760	迈瑞医疗	111,189	34,824,394.80	0.94
36	002371	北方华创	119,086	33,001,112.32	0.89
37	601888	中国中免	139,997	32,609,501.21	0.88
38	300014	亿纬锂能	307,001	29,932,597.50	0.81
39	601985	中国核电	4,157,300	28,519,078.00	0.77
40	605376	博迁新材	470,000	27,401,000.00	0.74
41	600276	恒瑞医药	645,040	23,924,533.60	0.65
42	688778	厦钨新能	153,447	17,104,737.09	0.46

43	00558	力劲科技	1,165,000	14,944,445.25	0.40
44	601778	晶科科技	2,800,000	14,924,000.00	0.40
45	01347	华虹半导体	597,102	14,502,052.73	0.39
46	300059	东方财富	568,525	14,440,535.00	0.39
47	603713	密尔克卫	96,700	13,218,890.00	0.36
48	688032	禾迈股份	9,224	8,034,104.00	0.22
49	688052	纳芯微	6,090	2,136,432.90	0.06
50	688326	经纬恒润	6,832	915,966.24	0.02
51	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
52	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
53	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
54	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
55	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
56	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.00
57	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
58	002460	赣锋锂业	100	14,870.00	0.00
59	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688008	澜起科技	240,277,729.06	5.65
2	002594	比亚迪	86,770,514.17	2.04
2	01211	比亚迪股份	63,675,380.81	1.50
3	600426	华鲁恒升	136,557,129.07	3.21
4	01801	信达生物	122,072,107.13	2.87
5	300750	宁德时代	106,881,826.50	2.51
6	002353	杰瑞股份	104,422,667.35	2.46
7	002371	北方华创	95,507,857.98	2.25
8	300496	中科创达	93,651,651.21	2.20
9	601021	春秋航空	93,598,696.32	2.20
10	300274	阳光电源	87,380,537.59	2.05
11	00883	中国海洋石油	63,198,189.38	1.49
11	600938	中国海油	18,033,401.31	0.42
12	600309	万华化学	78,017,698.16	1.83
13	601012	隆基绿能	73,869,068.38	1.74
14	600161	天坛生物	71,090,008.04	1.67
15	688981	中芯国际	35,757,509.32	0.84
15	00981	中芯国际	34,866,761.26	0.82

16	300059	东方财富	69,128,096.72	1.63
17	600256	广汇能源	68,373,459.72	1.61
18	300327	中颖电子	67,627,816.93	1.59
19	600399	抚顺特钢	67,211,545.00	1.58
20	300014	亿纬锂能	65,420,301.40	1.54

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600426	华鲁恒升	129,797,201.49	3.05
2	000963	华东医药	117,839,120.42	2.77
3	600905	三峡能源	106,023,465.86	2.49
4	002371	北方华创	101,586,736.66	2.39
5	300760	迈瑞医疗	100,032,715.00	2.35
6	300724	捷佳伟创	93,662,224.87	2.20
7	002212	天融信	93,562,272.96	2.20
8	600009	上海机场	92,372,865.44	2.17
9	000733	振华科技	88,530,262.16	2.08
10	600256	广汇能源	81,159,670.13	1.91
11	600161	天坛生物	78,074,306.76	1.84
12	002049	紫光国微	72,565,980.93	1.71
13	000001	平安银行	72,549,133.69	1.71
14	601778	晶科科技	72,094,001.98	1.70
15	688981	中芯国际	35,446,802.65	0.83
15	00981	中芯国际	31,660,895.43	0.74
16	002603	以岭药业	66,749,222.03	1.57
17	300059	东方财富	64,026,712.23	1.51
18	06078	海吉亚医疗	63,780,613.48	1.50
19	300476	胜宏科技	61,201,816.03	1.44
20	01024	快手-W	58,305,180.87	1.37

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,409,833,358.58
卖出股票收入（成交）总额	3,250,918,994.36

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	192,009,627.40	5.20
	其中：政策性金融债	192,009,627.40	5.20
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	192,009,627.40	5.20

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	220201	22 国开 01	1,900,000	192,009,627.40	5.20

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，故此项不适用。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查的情形，未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,285,891.23
2	应收清算款	89,927,462.91
3	应收股利	4,951,399.19
4	应收利息	-
5	应收申购款	100,635.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,265,389.22

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
兴全合远	61,926	62,912.15	28,398,911.39	0.73	3,867,498,937.76	99.27

两年持有混合 A						
兴全合远两年持有混合 C	9,404	19,448.81	2,150,430.15	1.18	180,746,144.89	98.82
合计	71,330	57,182.03	30,549,341.54	0.75	4,048,245,082.65	99.25

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全合远两年持有混合 A	947,452.17	0.0243
	兴全合远两年持有混合 C	10,442.47	0.0057
	合计	957,894.64	0.0235

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	兴全合远两年持有混合 A	0
	兴全合远两年持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全合远两年持有混合 A	50~100
	兴全合远两年持有混合 C	0
	合计	50~100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全合远两年持有混合 A	兴全合远两年持有混合 C
基金合同生效日（2021年4月27日）基金份额总额	3,855,648,664.31	176,440,952.31
本报告期期初基金份额总额	3,879,688,821.47	180,544,889.71
本报告期基金总申购份额	16,209,027.68	2,351,685.33

减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,895,897,849.15	182,896,575.04

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动。

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

(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

广发证券	4	1,158,604,281.93	17.43	774,973.91	16.67	-
中信建投证券	5	899,932,946.42	13.54	593,304.59	12.76	-
兴业证券	4	700,294,012.55	10.53	658,956.65	14.18	-
中信证券	5	662,233,907.68	9.96	484,290.99	10.42	-
中金公司	2	578,968,230.65	8.71	376,166.82	8.09	-
华创证券	1	517,866,076.53	7.79	378,713.54	8.15	-
招商证券	2	381,690,419.62	5.74	286,643.21	6.17	-
申万宏源证券	2	341,032,492.39	5.13	152,403.37	3.28	-
天风证券	2	321,857,901.65	4.84	213,141.35	4.59	-
东吴证券	2	271,965,632.54	4.09	171,694.68	3.69	-
国盛证券	2	237,901,294.00	3.58	152,455.24	3.28	-
民生证券	1	202,490,409.27	3.05	148,079.67	3.19	-
国信证券	2	107,746,990.26	1.62	78,795.59	1.70	-
安信证券	2	81,708,727.06	1.23	59,758.36	1.29	-
摩根大通证券	2	70,999,516.83	1.07	45,905.62	0.99	-
国金证券	2	67,863,889.97	1.02	44,554.02	0.96	-
中国中金财富证券	4	45,582,162.00	0.69	28,775.95	0.62	-
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	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

南京证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-

东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-01-05
2	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-01-06
3	关于副总经理离任的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-01-21
4	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-01-26
5	关于使用自有资金自购旗下偏股型公募基金壹亿元的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-01-27
6	关于公司副总经理任职的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-01-28
7	关于兴全合远两年持有期混合型证券投资基金恢复接受大额申购（含定投）、大额转换转入申请的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-03-11
8	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-03-15
9	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-05-06
10	关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联 网网站	2022-05-13
11	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	上海证券报、规定互联 网网站	2022-06-17
12	关于公司副总经理变更的公告	上海证券报、规定互联	2022-06-30

	网网站	
--	-----	--

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期未发生单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。							

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴全合远两年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全合远两年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全合远两年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册兴全合远两年持有期混合型证券投资基金的法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；

7. 中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站 (<http://www.xqfunds.com>) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

基金管理人客户服务电话: 400-678-0099, 021-38824536。

兴证全球基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日