

兴全可转债混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55

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	55
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	61
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全可转债混合型证券投资基金
基金简称	兴全可转债混合
基金主代码	340001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,570,074,147.89 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴全可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398988	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-30 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		201204	100140
法定代表人		杨华辉	陈四清

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	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-30 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-76,424,574.62
本期利润	-19,076,867.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0052
本期加权平均净值利润率	-0.48%
本期基金份额净值增长率	-0.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	200,294,984.18
期末可供分配基金份额利润	0.0561
期末基金资产净值	3,789,652,880.19
期末基金份额净值	1.0615
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	978.90%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

	率①	准差②	率③	④		
过去一个月	0.88%	0.47%	0.88%	0.39%	0.00%	0.08%
过去三个月	-2.01%	0.46%	-0.89%	0.43%	-1.12%	0.03%
过去六个月	-0.49%	0.45%	2.61%	0.42%	-3.10%	0.03%
过去一年	-6.60%	0.51%	-4.57%	0.49%	-2.03%	0.02%
过去三年	16.96%	0.70%	13.44%	0.63%	3.52%	0.07%
自基金合同生效起至今	978.90%	0.80%	188.44%	1.06%	790.46%	-0.26%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：选取中证可转换债券指数和沪深 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“中证可转换债券指数”是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。沪深 300 指数代表效果较好。

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：

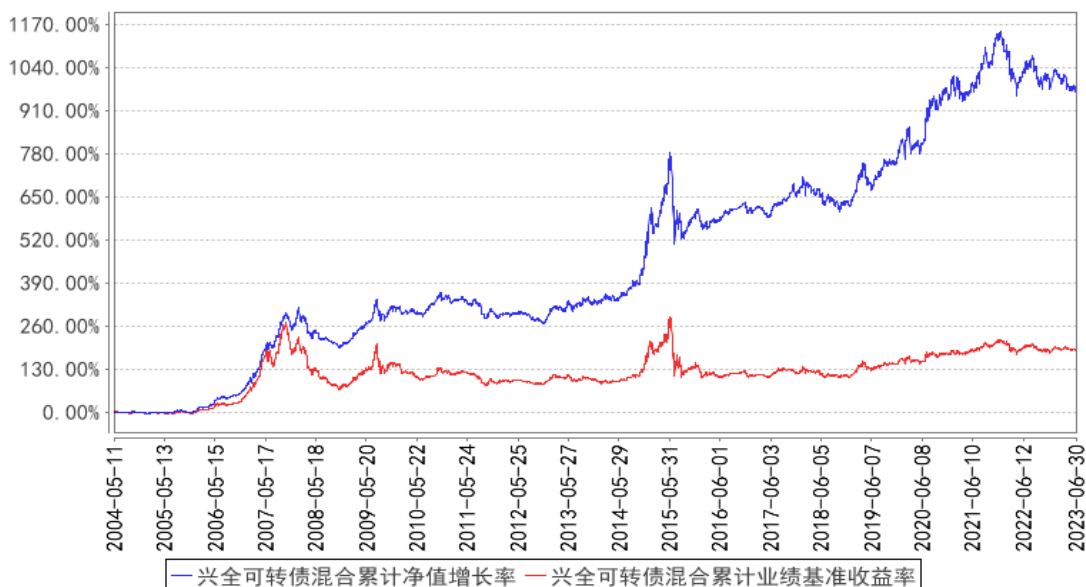
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中证可转换债券指数}_t / \text{中证可转换债券指数}_{t-1} - 1) + 15\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

兴全可转债混合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 2023 年 6 月 30 日。

2、按照《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2004 年 5 月 11 日至 2004 年 11 月 10 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”。

截至2023年6月30日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共58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		
虞淼	兴全可转债混合型证券投资基金、兴证全球兴益债券型证券投资基金基金经理	2019年1月16日	-	13年	硕士，历任兴业证券股份有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、专户投资经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年国内经济呈现曲折复苏的节奏，一季度国内经济持续修复，二季度则进入整固期。在海外联储加息的大环境下，全球经济增长边际放缓，但仍呈现出一定的韧性。美联储持续提升目标率以应对偏高的通胀水平，导致上半年美债利率维持在相对高位，而美元指数在经历了 2022 四季度的走弱后开始震荡。全球制造业 PMI 连续 10 个月低于荣枯线，大宗商品价格则在高位震荡，美国就业市场的表现也持续好于预期。外围宏观环境强于此前的预期，衰退的预期有所修正。

上半年国内权益市场结构分化明显，机会与挑战并存。沪深 300 下跌 0.8%，中证 500 上涨

2.3%，创业板指则下跌 5.6%。通信、传媒和计算机板块表现较好，而商贸零售、房地产等板块跌幅较大。以 AI 相关行业为代表的科技类行业在上半年表现突出，顺周期行业则受房地产销售低迷、经济上行动能边际趋缓的影响，表现整体偏弱。在宽货币、经济曲折修复的宏观背景下，债市震荡走强，国债收益率下行约 20 个 bp 至 2.64%。

中证转债指数在 2023 年上半年上涨约 3.4%。可转债市场 2022 年末受债市调整的影响估值压缩，而 2023 年随着债市的走强，可转债估值有一定程度的扩张，部分权重个券的表现相对较好。

本基金在 2023 年上半年维持了相对较高的股票仓位，可转债的配置比例有所提升。回顾半年的操作，在 2022 年末对可转债资产的增持幅度不足，一季度组合向上的弹性有所欠缺。上半年行情分化明显，AI 等部分主线品种涨幅较大，多数板块承压，组合在持仓结构上对于 AI 相关板块的配置比例偏低，而配置其他板块个股也有一定程度的负向拖累，导致上半年的组合表现不理想。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0615 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.49%，业绩比较基准收益率为 2.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外通胀接近高位，外部流动性仍有改善的空间，而外需有边际放缓的压力。国内经济延续了曲折修复的格局，下半年稳增长政策的落地将在一定程度影响复苏的节奏和方向。以 PPI 为代表的国内工业品价格，经历了多个季度持续下行后有望边际企稳，对于部分子行业的盈利产生正面的影响。展望未来，企业盈利增长的亮点会有所增加，同时各行业复苏的节奏预计仍将有较大的结构性差异。科技类行业在上半年已经出现了新的变化，新技术的影响及其带来的产业链的机会，仍将是未来重要的投资线索。从长期的角度看，在目前的估值水平下，权益资产仍然具有较为明显的配置价值，市场相对可为，结构也同样重要。

可转债资产的整体估值水平在上半年有所提升，新发数量持续增加，也出现了退市个券，资产内部结构的分化同样显著，与权益资产类似，可转债的分化长期看将成为常态。

本基金将秉承“严控下行风险”的理念，灵活配置资产，挑选价值类型的个券，尽量追求“相对安全的收益”。

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、合规管理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；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

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》、《兴全可转债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

本报告期内，本基金托管人在对兴全可转债混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，兴全可转债混合型证券投资基金的管理人——兴证全球基金管理有限公司在兴全可转债混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴全可转债混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对兴证全球基金管理有限公司编制和披露的兴全可转债混合型证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	320,750,476.17	550,923,825.75
结算备付金		1,947,325.08	1,545,887.77
存出保证金		242,550.41	223,193.12
交易性金融资产	6.4.7.2	3,449,701,314.32	3,394,001,476.32
其中：股票投资		958,789,658.64	1,013,026,460.64
基金投资		-	-
债券投资		2,490,911,655.68	2,380,975,015.68
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	303,288,000.00	300,000,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		18,226,009.82	12,010,687.76
应收股利		-	-
应收申购款		622,037.05	880,550.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,094,777,712.85	4,259,585,620.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		296,620,238.47	309,835,368.27
应付赎回款		2,730,086.00	1,164,372.86

应付管理人报酬		4,055,723.16	4,404,574.48
应付托管费		779,946.74	847,033.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,707.78	22,521.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	914,130.51	777,396.66
负债合计		305,124,832.66	317,051,267.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,570,074,147.89	3,696,115,715.02
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	219,578,732.30	246,418,638.37
净资产合计		3,789,652,880.19	3,942,534,353.39
负债和净资产总计		4,094,777,712.85	4,259,585,620.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0615 元，基金份额总额 3,570,074,147.89 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		11,527,775.30	-325,401,630.26
1. 利息收入		895,233.85	1,795,625.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	816,439.47	1,450,572.95
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		78,794.38	345,052.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-47,028,998.99	-46,836,598.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-71,234,069.29	-106,740,166.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	14,660,442.64	51,155,041.68

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	9,544,627.66	8,748,525.95
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	57,347,707.00	-280,811,110.88
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	313,833.44	450,454.03
减：二、营业总支出		30,604,642.92	34,206,053.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,565,028.46	28,587,123.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,916,351.61	5,497,523.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
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		16,242.16	14,475.55
8. 其他费用	6.4.7.23	107,020.69	106,930.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,076,867.62	-359,607,684.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,076,867.62	-359,607,684.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,076,867.62	-359,607,684.01

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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)	3,696,115,715.02	-	246,418,638.37	3,942,534,353.39
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)	3,696,115,715.02	-	246,418,638.37	3,942,534,353.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-26,839,906.07	-152,881,473.20
(一)、综合收益总额	126,041,567.13	-	-19,076,867.62	-19,076,867.62
(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)	-	-	-7,763,038.45	-133,804,605.58
其中：1. 基金申购款	126,041,567.13	-	21,265,550.28	256,382,153.19
2. 基金赎回款	-	-	-29,028,588.73	-390,186,758.77
(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)	235,116,602.91	-	-	-
(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)	3,570,074,147.89	-	219,578,732.30	3,789,652,880.19
项目	上年度可比期间 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)	3,853,910,496.17	-	877,414,663.73	4,731,325,159.90

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)	3,853,910,496.17	-	877,414,663.73	4,731,325,159.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	62,841,974.24	-	342,880,695.01	-280,038,720.77
(一)、综合收益总额	-	-	359,607,684.01	-359,607,684.01
(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)	62,841,974.24	-	16,726,989.00	79,568,963.24
其中：1. 基金申购款	569,342,250.78	-	80,877,897.60	650,220,148.38
2. 基金赎回款	-506,500,276.54	-	-64,150,908.60	-570,651,185.14
(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)	3,916,752,470.41	-	534,533,968.72	4,451,286,439.13

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

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全可转债混合型证券投资基金(原名兴业可转债混合型证券投资基金,以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]27号文《关于同意兴业可转债混合型证券投资基金设立的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于2004年5月11日正式生效,首次设立募集规模为3,282,404,810.93份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于2011年1月1日起更名为兴全可转债混合型证券投资基金。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、国债,以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。资产配置比例为:可转债30%~95%(其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于50%),股票不高于30%,现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深300指数+5%×同业存款利率”。

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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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

根据财税[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《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]140号《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《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，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金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。

(2) 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,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;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,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2023年6月30日
活期存款	320,750,476.17
等于：本金	320,723,326.09
加：应计利息	27,150.08
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	320,750,476.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,034,033,021.74	-	958,789,658.64	-75,243,363.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	7,117,662.71	2,288,288,368.01	-31,388,876.03
	银行间市场	199,595,400.00	2,703,287.67	324,600.00
	合计	2,512,154,981.33	9,820,950.38	2,490,911,655.68
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,546,188,003.07	9,820,950.38	3,449,701,314.32	106,307,639.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	303,288,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	303,288,000.00	-

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

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,303.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	823,046.95
其中：交易所市场	823,046.95
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	914,130.51

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,696,115,715.02	3,696,115,715.02
本期申购	235,116,602.91	235,116,602.91
本期赎回（以“-”号填列）	-361,158,170.04	-361,158,170.04
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	3,570,074,147.89	3,570,074,147.89

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

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	285,000,314.77	-38,581,676.40	246,418,638.37
本期利润	-76,424,574.62	57,347,707.00	-19,076,867.62
本期基金份额交易产生的变动数	-8,280,755.97	517,717.52	-7,763,038.45
其中：基金申购款	17,227,101.71	4,038,448.57	21,265,550.28
基金赎回款	-25,507,857.68	-3,520,731.05	-29,028,588.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	200,294,984.18	19,283,748.12	219,578,732.30

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	794,824.95
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	19,397.88
其他	2,216.64
合计	816,439.47

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-71,234,069.29
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	-71,234,069.29

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	893,185,571.53
减：卖出股票成本总额	961,934,464.26
减：交易费用	2,485,176.56
买卖股票差价收入	-71,234,069.29

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,223,231.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,437,211.20
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	14,660,442.64

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	830,048,603.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	821,788,707.27
减：应计利息总额	2,709,985.56
减：交易费用	112,699.48
买卖债券差价收入	5,437,211.20

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

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

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

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,544,627.66
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	9,544,627.66

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	57,347,707.00
股票投资	4,400,346.71
债券投资	52,947,360.29
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	57,347,707.00

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	311,726.19
基金转换费收入	2,107.25
合计	313,833.44

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,640.24
账户维护费	18,600.00
合计	107,020.69

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

根据本基金的基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日起基金管理费率自 1.30% 降低至 1.20%，托管费率自 0.25% 降低至 0.20%。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司(“兴证全球基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	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

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 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
兴业证券	843,407,482.11	48.41	836,497,508.19	44.12

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例(%)
兴业证券	711,171,920.53	45.15	800,543,571.33	44.71

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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 2023年1月1日至2023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	616,788.35	41.00	281,136.44	34.16

关联方名称	上年度可比期间 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	611,731.40	36.47	317,263.88	44.69

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,565,028.46	28,587,123.69
其中：支付销售机构的客户维护 费	6,775,396.54	7,205,335.54

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30% 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×1.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,916,351.61	5,497,523.85

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

注：无。

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：本基金本报告期内及上年度可比期间内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：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率

的证券出借业务的情况。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人均无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末和上年度末均未投资本基金。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
工商银行	320,750,476.17	794,824.95	926,733,594.16	1,420,488.67

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
兴业证券	688469	中芯集成	首次公开发行网下申购	137,994	785,185.86
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

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（2023 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
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海	2023	6个月	新	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

	森药业	年 3 月 30 日		股 流 通 受 限						
002765	蓝黛科技	2023 年 2 月 17 日	6 个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限	7.91	8.04	884,956	7,000,001.96	7,115,046.24	-
002865	钧达股份	2023 年 6 月 16 日	6 个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限	100.00	138.51	60,000	6,000,000.00	8,310,600.00	-
300442	润泽科技	2023 年 2 月 14 日	6 个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限	35.22	29.60	283,930	10,000,014.60	8,404,328.00	-
300442	润泽科技	2023 年 5 月 24 日	3 个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限 - 转 增	-	29.60	227,144	-	6,723,462.40	注 1

301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301292	海科	2023年6月	1个月内	新股	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-

	新源	月 29 日	(含)	流 通 受 限							
301292	海科新源	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-	
301301	川宁生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-	
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-	
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新 股 流 通	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-	

				受限							
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-	
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-	
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-	
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-	
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	6个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-	

601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603137	恒尚节能	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
603912	佳力图	2023年3月30日	6个月	非公开发发行流通受限	10.95	9.49	547,945	5,999,997.75	5,199,998.05	-
603912	佳力图	2023年6月9日	4个月	非公开发发行	-	9.49	219,178	-	2,079,999.22	注2

				流通受限 - 转增						
603936	博敏电子	2023年4月10日	6个月	非公开发行人流通受限	11.81	11.43	508,044	5,999,999.64	5,806,942.92	-
688008	澜起科技	2023年3月24日	6个月	大宗交易购入流通受限	65.80	54.31	159,346	10,484,966.80	8,654,081.26	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688343	云天励飞	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	43.92	50.67	24,961	1,096,287.12	1,264,773.87	-

688352	顾中科技	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车	2023年5月	6个月	新股	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-

	科技	月 4 日		流通受限						
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688485	九州一轨	2023 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	4 个月	新股流通受限 - 转增	-	122.11	72	-	8,791.92	注 3
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国	2023	6 个月	新	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-

	科军工	年6月14日		股流通受限						
688552	航天南湖	2023年5月8日	6个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023年5月12日	6个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023年5月25日	6个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688603	天承科技	2023年6月30日	1个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科	2023年6月	6个月	新股流	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-

	技	30 日		通 受 限						
688623	双 元 科 技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华 丰 科 技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱 斯 信 息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688789	宏 华 数 科	2023 年 2 月 9 日	6 个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限	144.00	85.86	48,611	6,999,984.00	4,173,740.46	-
688789	宏 华 数 科	2023 年 6 月 2 日	3 个月	非 公 开 发 行 流 通 受 限 - 转 增	-	85.86	21,875	-	1,878,187.50	注 4

注：1、本基金持有的非公开发行股票润泽科技，于 2023 年 5 月 24 日实施 2022 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股转增 8 股。本基金新增 227,114.00 股。

2、本基金持有的非公开发行股票佳力图，于 2023 年 6 月 9 日实施 2022 年年度权益分配方案，每股派发现金红利 0.10 元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增 0.4 股。本基金新增 219,178 股。

3、本基金持有的新股流通受限股票索辰科技，于 2023 年 6 月 20 日实施 2022 年年度权益分配方案，每股派发现金红利 0.15 元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增 0.48 股。本基金新增 72 股。

4、本基金持有的非公开发行股票宏华数科，于 2023 年 6 月 2 日实施 2022 年年度权益分配方案，每股派发现金红利 0.90 元（含税），以资本公积金向全体股东每股转增 0.45 股。本基金新增 21,875 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流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本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：本基金于报告期及上年度可比期间均未参与因转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

证券，不得超过该证券的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	812,585,968.86	914,465,909.81
AAA 以下	1,475,702,399.15	1,266,142,256.55
未评级	0.00	-
合计	2,288,288,368.01	2,180,608,166.36

注：此处的信用证券不包括国债、央票、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要

求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定的交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%。本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股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、权证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 202 3 年	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
------------------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

6月30日							
资产							
银行存款	320,750,476.17	-	-	-	-	-	320,750,476.17
结算备付金	1,947,325.08	-	-	-	-	-	1,947,325.08
存出保证金	242,550.41	-	-	-	-	-	242,550.41
交易性金融资产	-	202,623,287.67	139,364,063.92	1,670,906,720.83	478,017,583.26	958,789,658.64	3,449,701,314.32
买入返售金融资产	303,288,000.00	-	-	-	-	-	303,288,000.00
应收申购款	10,368.06	-	-	-	-	611,668.99	622,037.05
应收清算款	-	-	-	-	-	18,226,009.82	18,226,009.82

资产总计	626,238,719.72	202,623,287.67	139,364,063.92	1,670,906,720.83	478,017,583.26	977,627,337.45	4,094,777,712.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-2,730,086.00	-2,730,086.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-4,055,723.16	-4,055,723.16
应付托管费	-	-	-	-	-	779,946.74	779,946.74
应付清算款	-	-	-	-	-	296,620,238.47	296,620,238.47
应交税费	-	-	-	-	-	24,707.78	24,707.78
其他负债	-	-	-	-	-	914,130.51	914,130.51
负债总计	-	-	-	-	-	305,124,832.66	305,124,832.66
利率敏感度	626,238,719.72	202,623,287.67	139,364,063.92	1,670,906,720.83	478,017,583.26	672,502,504.79	3,789,652,880.19

缺口							
上 年 度 末 202 2 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	550,923,825.75	-	-	-	-	-	550,923,825.75
结 算 备 付 金	1,545,887.77	-	-	-	-	-	1,545,887.77
存 出 保 证 金	223,193.12	-	-	-	-	-	223,193.12
交 易 性 金 融 资 产	126,132,309.48	-	200,366,849.32	1,642,628,046.59	411,847,810.29	1,013,026,460.64	3,394,001,476.32
买 入 返 售 金 融 资 产	300,000,000.00	-	-	-	-	-	300,000,000.00
应	17,311.17	-	-	-	-	863,239.09	880,550.26

收申购款							
应收清算款	-	-	-	-	-	12,010,687.76	12,010,687.76
资产总计	978,842,527.29	200,366,849.32	1,642,628,046.59	411,847,810.29	1,025,900,387.49	4,259,585,620.98	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,164,372.86	1,164,372.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,404,574.48	4,404,574.48
应付托管费	-	-	-	-	-	847,033.54	847,033.54
应付清算款	-	-	-	-	-	309,835,368.27	309,835,368.27
应交税费	-	-	-	-	-	22,521.78	22,521.78
其他负债	-	-	-	-	-	777,396.66	777,396.66

负债总计						317,051,267.59	317,051,267.59
利率敏感度缺口	978,842,527.29		200,366,849.32	1,642,628,046.59	411,847,810.29	708,849,119.90	3,942,534,353.39

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)。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2023年6月30日)	上年度末(2022年12月31日)
	利率 +1%	-364,984.95	-1,329,571.25
	利率 -1%	366,322.41	1,347,556.27

注：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，为交易而持有的债权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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

注：本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中股票投资比例范围为不超过基金资产净值的 30%；可转债为 30%-95%；现金和到期日在一年以内的政府债券的比例在 5%以上，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	958,789,658.64	25.30	1,013,026,460.64	25.69
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,490,911,655.68	65.73	2,380,975,015.68	60.39
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	3,449,701,314.32	91.03	3,394,001,476.32	86.09

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准+10%	348,934,725.76	370,607,613.34
	业绩比较基准-10%	-348,934,725.76	-370,607,613.34

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	3,139,628,610.44	2,962,637,369.36
第二层次	249,246,872.30	350,009,273.00
第三层次	60,825,831.58	81,354,833.96
合计	3,449,701,314.32	3,394,001,476.32

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 2023 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（2022 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	958,789,658.64	23.41
	其中：股票	958,789,658.64	23.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,490,911,655.68	60.83
	其中：债券	2,490,911,655.68	60.83
	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	303,288,000.00	7.41
	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	322,697,801.25	7.88
8	其他各项资产	19,090,597.28	0.47
9	合计	4,094,777,712.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	26,240,402.31	0.69
C	制造业	663,798,720.24	17.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	18,903,244.92	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	33,363,520.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,718,339.89	1.10
J	金融业	25,532,355.00	0.67
K	房地产业	108,598,561.06	2.87
L	租赁和商务服务业	23,544,213.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	54,308.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	16,990,030.00	0.45
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	958,789,658.64	25.30

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利发展	6,698,002	87,274,966.06	2.30
2	002475	立讯精密	1,261,616	40,939,439.20	1.08
3	002223	鱼跃医疗	1,084,801	39,041,987.99	1.03
4	000733	振华科技	319,500	30,624,075.00	0.81
5	603699	纽威股份	1,900,674	28,282,029.12	0.75
6	688099	晶晨股份	333,116	28,088,341.12	0.74
7	002078	太阳纸业	2,560,100	27,367,469.00	0.72
8	000738	航发控制	1,082,399	26,410,535.60	0.70
9	601899	紫金矿业	2,307,863	26,240,402.31	0.69
10	300337	银邦股份	3,902,700	26,031,009.00	0.69
11	002415	海康威视	767,859	25,423,811.49	0.67
12	002158	汉钟精机	1,017,811	25,404,562.56	0.67
13	002027	分众传媒	3,457,300	23,544,213.00	0.62
14	300401	花园生物	1,996,538	23,199,771.56	0.61
15	600690	海尔智家	986,510	23,163,254.80	0.61
16	603867	新化股份	562,731	22,790,605.50	0.60
17	600161	天坛生物	824,641	22,389,003.15	0.59
18	002672	东江环保	3,713,397	22,094,712.15	0.58
19	000063	中兴通讯	480,900	21,900,186.00	0.58
20	002138	顺络电子	912,473	21,817,229.43	0.58
21	001979	招商蛇口	1,636,500	21,323,595.00	0.56
22	688009	中国通号	3,443,924	19,974,759.20	0.53

23	601333	广深铁路	5,005,500	19,821,780.00	0.52
24	002505	鹏都农牧	9,981,300	18,864,657.00	0.50
25	002036	联创电子	1,906,990	18,516,872.90	0.49
26	002607	中公教育	3,614,900	16,990,030.00	0.45
27	002371	北方华创	53,200	16,898,980.00	0.45
28	603773	沃格光电	531,500	16,774,140.00	0.44
29	300791	仙乐健康	564,468	16,392,150.72	0.43
30	002179	中航光电	341,380	15,481,583.00	0.41
31	300442	润泽科技	511,074	15,127,790.40	0.40
32	002120	韵达股份	1,416,500	13,541,740.00	0.36
33	600109	国金证券	1,534,300	13,302,381.00	0.35
34	603507	振江股份	366,100	13,274,786.00	0.35
35	002430	杭氧股份	380,841	13,085,696.76	0.35
36	300525	博思软件	801,228	12,290,837.52	0.32
37	600030	中信证券	618,300	12,229,974.00	0.32
38	603279	景津装备	373,654	11,717,789.44	0.31
39	603799	华友钴业	252,945	11,612,704.95	0.31
40	603896	寿仙谷	247,100	10,946,530.00	0.29
41	688008	澜起科技	159,346	8,654,081.26	0.23
42	002865	钧达股份	60,000	8,310,600.00	0.22
43	603912	佳力图	767,123	7,279,997.27	0.19
44	002765	蓝黛科技	884,956	7,115,046.24	0.19
45	688789	宏华数科	70,486	6,051,927.96	0.16
46	603936	博敏电子	508,044	5,806,942.92	0.15
47	603195	公牛集团	59,792	5,743,619.52	0.15
48	688661	和林微纳	70,551	4,959,735.30	0.13
49	688343	云天励飞	24,961	1,264,773.87	0.03
50	301358	湖南裕能	20,226	887,880.50	0.02
51	688361	中科飞测	8,303	673,991.49	0.02
52	688623	双元科技	1,776	162,256.88	0.00
53	301332	德尔玛	11,211	159,576.87	0.00
54	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
55	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
56	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
57	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
58	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
59	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
60	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
61	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
62	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
63	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
64	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
65	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00

66	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
67	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
68	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
69	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
70	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
71	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
72	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
73	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
74	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
75	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
76	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
77	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
78	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
79	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
80	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
81	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
82	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
83	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
84	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
85	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
86	301170	锡南科技	296	10,443.70	0.00
87	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
88	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
89	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
90	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
91	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
92	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
93	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
94	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
95	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
96	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
97	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
98	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
99	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
100	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
101	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
102	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
103	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
104	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	002078	太阳纸业	32,074,749.00	0.81
2	688009	中国通号	29,283,756.01	0.74
3	001979	招商蛇口	28,118,784.00	0.71
4	002672	东江环保	26,162,688.94	0.66
5	603699	纽威股份	25,807,094.57	0.65
6	002027	分众传媒	24,894,827.00	0.63
7	603867	新化股份	23,776,324.40	0.60
8	000928	中钢国际	22,602,283.78	0.57
9	600161	天坛生物	22,415,193.97	0.57
10	601333	广深铁路	21,205,322.00	0.54
11	002607	中公教育	19,045,606.00	0.48
12	688029	南微医学	18,620,736.67	0.47
13	603806	福斯特	18,529,099.50	0.47
14	300525	博思软件	18,038,901.95	0.46
15	300803	指南针	17,910,005.77	0.45
16	688008	澜起科技	17,634,780.62	0.45
17	000063	中兴通讯	17,252,477.00	0.44
18	601231	环旭电子	16,841,908.00	0.43
19	300161	华中数控	16,111,173.00	0.41
20	688232	新点软件	16,074,244.29	0.41

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	601117	中国化学	35,787,647.20	0.91
2	601166	兴业银行	30,841,035.48	0.78
3	000928	中钢国际	28,551,144.87	0.72
4	300059	东方财富	28,403,368.12	0.72
5	002250	联化科技	25,996,696.00	0.66
6	601012	隆基绿能	23,140,382.87	0.59
7	000776	广发证券	22,566,691.08	0.57
8	000739	普洛药业	22,488,069.19	0.57
9	002938	鹏鼎控股	21,448,478.16	0.54
10	300161	华中数控	20,180,665.00	0.51
11	601677	明泰铝业	20,078,084.50	0.51
12	300803	指南针	19,800,533.38	0.50
13	300413	芒果超媒	19,257,712.00	0.49
14	002317	众生药业	19,175,136.24	0.49
15	601998	中信银行	18,891,561.95	0.48
16	002812	恩捷股份	18,792,959.00	0.48
17	300592	华凯易佰	18,267,034.00	0.46

18	002049	紫光国微	17,612,694.50	0.45
19	001322	箭牌家居	17,557,776.55	0.45
20	688029	南微医学	16,697,842.57	0.42

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	903,297,315.55
卖出股票收入（成交）总额	893,185,571.53

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	202,623,287.67	5.35
	其中：政策性金融债	202,623,287.67	5.35
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）	2,288,288,368.01	60.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,490,911,655.68	65.73

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	220408	22 农发 08	2,000,000	202,623,287.67	5.35
2	110045	海澜转债	1,193,780	150,172,519.94	3.96
3	110081	闻泰转债	1,200,600	134,140,834.15	3.54
4	110053	苏银转债	1,005,170	126,366,116.95	3.33
5	110059	浦发转债	1,118,890	120,943,364.42	3.19

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 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中，江苏银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有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。

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	242,550.41
2	应收清算款	18,226,009.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	622,037.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,090,597.28

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	110045	海澜转债	150,172,519.94	3.96
2	110081	闻泰转债	134,140,834.15	3.54
3	110053	苏银转债	126,366,116.95	3.33
4	110059	浦发转债	120,943,364.42	3.19
5	113050	南银转债	87,636,937.97	2.31
6	110075	南航转债	85,226,453.53	2.25
7	110072	广汇转债	83,077,190.34	2.19
8	113045	环旭转债	64,321,162.04	1.70
9	127006	敖东转债	58,494,665.84	1.54
10	110073	国投转债	47,128,509.58	1.24
11	113043	财通转债	44,959,129.04	1.19
12	113052	兴业转债	42,522,165.41	1.12
13	132018	G 三峡 EB1	41,745,424.38	1.10
14	118023	广大转债	39,631,852.41	1.05
15	123119	康泰转 2	39,580,840.41	1.04
16	113063	赛轮转债	37,992,921.64	1.00
17	123107	温氏转债	35,164,375.75	0.93
18	127045	牧原转债	33,046,531.90	0.87
19	127005	长证转债	32,764,271.26	0.86
20	113062	常银转债	29,883,062.75	0.79
21	113057	中银转债	29,676,069.38	0.78
22	127039	北港转债	27,066,262.36	0.71
23	110079	杭银转债	26,069,259.54	0.69
24	110080	东湖转债	25,613,878.51	0.68
25	113663	新化转债	24,535,853.98	0.65
26	113660	寿 22 转债	22,512,807.10	0.59
27	110085	通 22 转债	21,082,067.47	0.56
28	127052	西子转债	20,733,822.62	0.55
29	113641	华友转债	20,132,388.39	0.53
30	123101	拓斯转债	19,893,841.06	0.52
31	128142	新乳转债	19,286,182.98	0.51
32	110060	天路转债	19,238,806.41	0.51
33	113563	柳药转债	18,271,773.38	0.48
34	127018	本钢转债	17,874,422.40	0.47
35	113627	太平转债	17,635,580.68	0.47
36	123169	正海转债	17,571,465.88	0.46
37	113059	福莱转债	17,144,394.44	0.45
38	111000	起帆转债	16,721,288.12	0.44
39	127063	贵轮转债	16,462,301.67	0.43
40	113606	荣泰转债	16,096,759.51	0.42
41	113569	科达转债	15,172,375.90	0.40
42	113602	景 20 转债	14,778,968.26	0.39
43	127070	大中转债	13,980,948.48	0.37

44	118029	富淼转债	13,803,833.04	0.36
45	128101	联创转债	13,244,670.38	0.35
46	113039	嘉泽转债	13,228,228.20	0.35
47	127068	顺博转债	13,058,374.31	0.34
48	128081	海亮转债	12,776,032.03	0.34
49	128097	奥佳转债	12,129,404.02	0.32
50	123155	中陆转债	12,115,749.59	0.32
51	113058	友发转债	11,835,136.83	0.31
52	123092	天壕转债	11,426,644.45	0.30
53	128135	洽洽转债	11,423,571.77	0.30
54	128137	洁美转债	11,250,074.91	0.30
55	128144	利民转债	11,082,365.71	0.29
56	123130	设研转债	10,747,567.46	0.28
57	123035	利德转债	10,621,681.23	0.28
58	111009	盛泰转债	10,028,093.53	0.26
59	118019	金盘转债	9,909,244.51	0.26
60	127061	美锦转债	9,319,908.94	0.25
61	123120	隆华转债	8,653,027.76	0.23
62	113661	福 22 转债	8,269,922.62	0.22
63	123167	商络转债	7,749,140.54	0.20
64	127059	永东转 2	6,971,788.24	0.18
65	127040	国泰转债	6,739,006.42	0.18
66	118006	阿拉转债	6,446,506.27	0.17
67	113504	艾华转债	6,359,702.44	0.17
68	123099	普利转债	6,208,501.70	0.16
69	110047	山鹰转债	5,939,287.14	0.16
70	127077	华宏转债	5,900,742.23	0.16
71	123144	裕兴转债	5,383,333.77	0.14
72	118024	冠宇转债	4,884,338.49	0.13
73	132026	G 三峡 EB2	4,429,276.55	0.12
74	110088	淮 22 转债	4,428,770.17	0.12
75	123133	佩蒂转债	3,445,758.29	0.09
76	113537	文灿转债	2,385,199.82	0.06
77	127066	科利转债	2,051,314.35	0.05
78	128140	润建转债	1,983,174.43	0.05
79	118021	新致转债	1,926,229.41	0.05

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的情况。

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

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（%）
147,687	24,173.25	596,086,395.94	16.70	2,973,987,751.95	83.30

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	5,458,448.69	0.1529

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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004年5月11日）基金份额总额	3,282,404,810.93
本报告期期初基金份额总额	3,696,115,715.02
本报告期基金总申购份额	235,116,602.91
减：本报告期基金总赎回份额	361,158,170.04
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,570,074,147.89

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无重大人事变动。

(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

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

10.6.1 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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%)	
兴业证券	3	843,407,482.11	48.41	616,788.35	41.00	-
中金公司	1	458,873,672.48	26.34	452,218.02	30.06	-
中信建投证券	1	287,610,133.24	16.51	283,911.11	18.87	-
国泰君安	2	119,331,461.61	6.85	119,401.50	7.94	-
光大证券	1	32,872,055.00	1.89	32,078.34	2.13	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能

力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

10.7.2 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(%)
兴业证券	711,171,920.53	45.15	-	-	-	-
中金公司	436,336,311.36	27.70	303,288,000.00	60.26	-	-
中信建投证券	265,395,123.60	16.85	200,000,000.00	39.74	-	-
国泰君安	137,883,902.94	8.75	-	-	-	-
光大证券	24,375,539.07	1.55	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

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	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资宏华数科(688789)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023年2月11日
2	兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金投资润泽科技(300442)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023年2月16日
3	关于旗下部分基金投资蓝黛科技(002765)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023年2月21日
4	关于增加广发银行股份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	2023年2月28日
5	关于增加上海华夏财富投资管理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	2023年3月23日

6	关于旗下部分基金投资佳力图（603912）非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网站	2023 年 4 月 1 日
7	关于旗下部分基金投资博敏电子（603936）非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网站	2023 年 4 月 12 日
8	关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、规定互联网站	2023 年 5 月 5 日
9	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网站	2023 年 6 月 14 日
10	关于旗下部分基金投资钧达股份（002865）非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网站	2023 年 6 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金的基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 7 月 10 日起基金管理费率自 1.30%降低至 1.20%，托管费率自 0.25%降低至 0.20%。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全可转债混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

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

2023 年 8 月 31 日