

# 兴全合泰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：招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。

基金托管人招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

<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 .....	12
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 .....	12
<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>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>54</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	54
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 .....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
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 .....	60
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 .....	61

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 .....	61
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 .....	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
7.12 投资组合报告附注 .....	61
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	63
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>63</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	63
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
10.8 其他重大事件 .....	67
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</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 .....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合泰混合型证券投资基金	
基金简称	兴全合泰混合	
基金主代码	007802	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 17 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	5,089,658,364.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C
下属分级基金的交易代码	007802	007803
报告期末下属分级基金的份额总额	4,180,105,508.70 份	909,552,855.46 份

### 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，追求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	张姗
	联系电话	021-20398888	0755-83077987
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398988	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-29 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	201204	518040
法定代表人	杨华辉	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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)		
	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C	
本期已实现收益	-375,315,999.78	-80,118,154.80	
本期利润	-629,282,720.47	-124,010,578.87	
加权平均基金份额本期利润	-0.1447	-0.1440	
本期加权平均净值利润率	-9.73%	-9.91%	
本期基金份额净值增长率	-8.95%	-9.22%	
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	1,633,203,894.25	327,643,796.02
	期末可供分配基金份额利润	0.3907	0.3602
	期末基金资产净值	5,813,309,402.95	1,237,196,651.48

期末基金份额净值	1.3907	1.3602
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	39.07%	36.02%

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

兴全合泰混合 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	4.24%	1.18%	1.90%	0.76%	2.34%	0.42%
过去三个月	-6.60%	1.12%	-3.34%	0.69%	-3.26%	0.43%
过去六个月	-8.95%	1.01%	-0.31%	0.71%	-8.64%	0.30%
过去一年	-21.37%	1.16%	-9.46%	0.86%	11.91%	0.30%
过去三年	17.40%	1.46%	-7.30%	0.94%	24.70%	0.52%
自基金合同生效起至今	39.07%	1.45%	-4.71%	0.96%	43.78%	0.49%

兴全合泰混合 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	4.19%	1.18%	1.90%	0.76%	2.29%	0.42%

过去三个月	-6.74%	1.12%	-3.34%	0.69%	-3.40%	0.43%
过去六个月	-9.22%	1.01%	-0.31%	0.71%	-8.91%	0.30%
过去一年	-21.85%	1.16%	-9.46%	0.86%	-12.39%	0.30%
过去三年	15.30%	1.46%	-7.30%	0.94%	22.60%	0.52%
自基金合同生效起至今	36.02%	1.45%	-4.71%	0.96%	40.73%	0.49%

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%

其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券投资业绩的比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

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

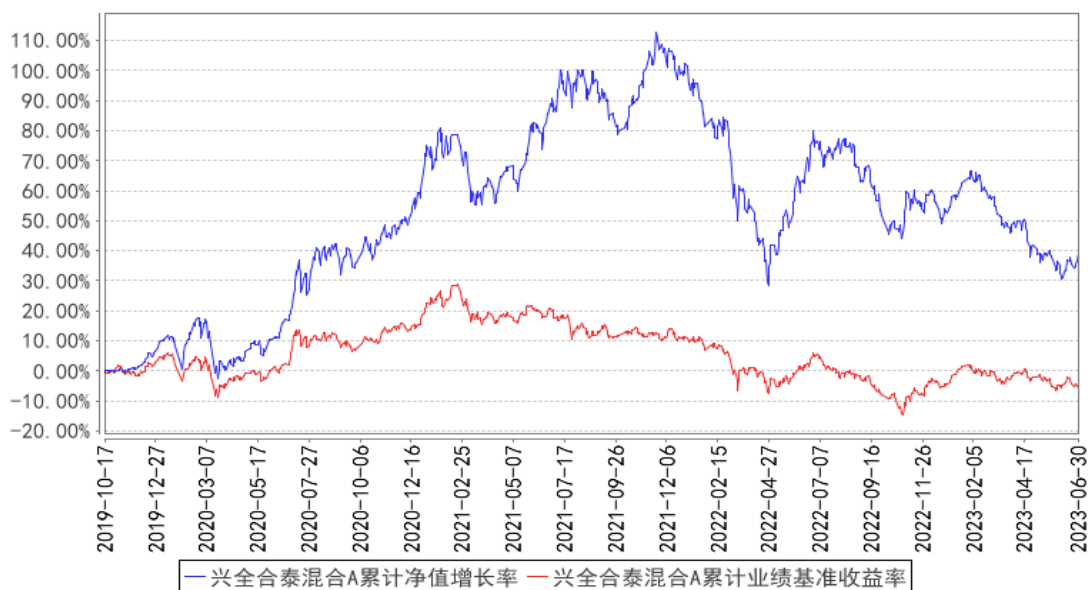
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

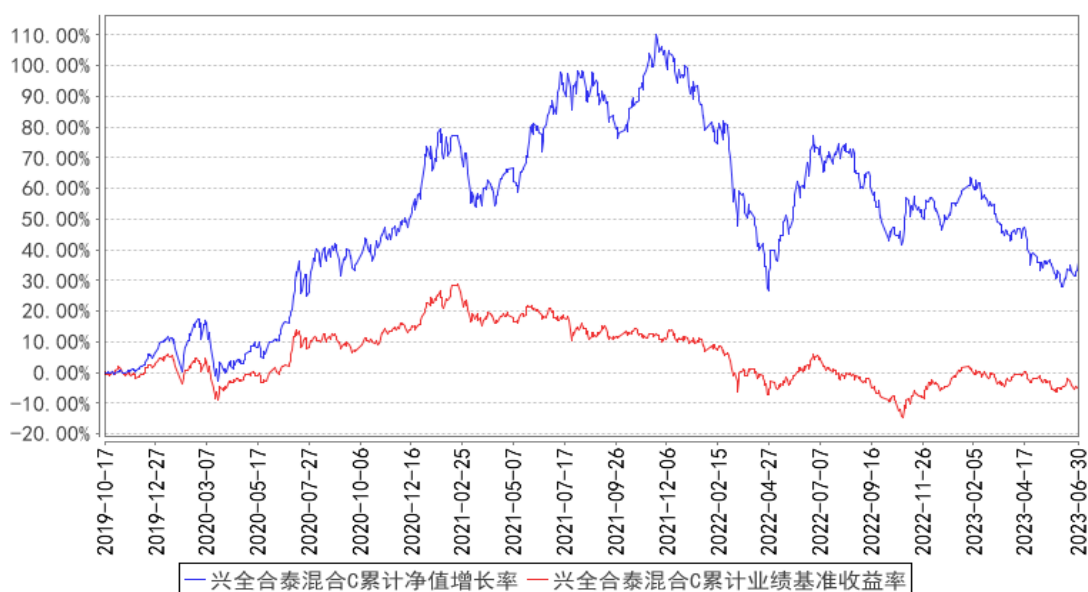


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴全合泰混合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



兴全合泰混合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 2023 年 06 月 30 日。

2、按照《兴全合泰混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2019 年 10 月 17 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 3.3 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		
任相栋	基金管理部副总监、兴全合泰混合型证券投资基金基金经理、兴证全球合衡三年持有期混合型证券投资基金基金经理	2019年10月17日	-	12年	硕士。历任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理，金鹰基金管理有限公司权益投资二部负责人。

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、《兴全合泰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

本基金上半年表现欠佳，主要由于市场情绪低迷，存量博弈特征明显，AI 和中特估是唯二主线，并且对其他板块挤出效应特别明显，强势板块的上涨带来的是其他板块的下跌。港股市场同样表现欠佳。低估值选股策略和基于交易为目的的选股策略总体占优，除此之外赚钱效应不明显。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全合泰混合 A 的基金份额净值为 1.3907 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.95%，同期业绩比较基准收益率为-0.31%；截至本报告期末兴全合泰混合 C 的基金份额净值为 1.3602 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.22%，同期业绩比较基准收益率为-0.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，当下股票市场的“政策底”已现，极度悲观的氛围使得市场下行空间不大。经济和对经济的预期是结束存量博弈行情的核心，我们对后续市场仍谨慎乐观，很多行业和公司经历了接近两年的调整，竞争格局和需求趋势都有望逐步好转。虽然股票市场波动很大，对前期看好的几条经济主线，我们还是抱有很大的信心。

当下基金行业“哑铃配置”流行，逐渐成为共识，我们认为可能低估了中国经济的潜力和有为政府的调控力度，当下虽然很难，未来仍有希望。

从投资的角度，本基金将更加注重投资中的节奏、力度和平衡感，未来将持续努力为持有人创造回报。

#### 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》、《兴全合泰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合规守信情况声明

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

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

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

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

本年度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：兴全合泰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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	269,341,402.67	112,544,731.11
结算备付金		7,541,949.62	8,495,689.69
存出保证金		1,117,136.98	1,363,991.70
交易性金融资产	6.4.7.2	6,854,654,544.70	7,657,500,125.48
其中：股票投资		6,392,947,209.64	7,203,811,331.85
基金投资		-	-
债券投资		461,707,335.06	453,688,793.63
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		20,592,861.91	-
应收股利		1,320,677.76	-
应收申购款		1,974,232.99	2,574,566.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		7,156,542,806.63	7,782,479,104.75
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		82,309,922.19	24,354,014.88
应付赎回款		7,679,818.42	5,656,289.13
应付管理人报酬		8,522,382.17	10,130,544.00
应付托管费		1,420,397.03	1,688,424.03
应付销售服务费		592,427.73	633,924.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		21.50	12.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	5,511,783.16	4,887,931.47
负债合计		106,036,752.20	47,351,140.06
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	5,089,658,364.16	5,079,598,630.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,960,847,690.27	2,655,529,333.98
净资产合计		7,050,506,054.43	7,735,127,964.69
负债和净资产总计		7,156,542,806.63	7,782,479,104.75

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，兴全合泰混合 A 基金份额净值 1.3907 元，基金份额总额 4,180,105,508.70 份；兴全合泰混合 C 基金份额净值 1.3602 元，基金份额总额 909,552,855.46 份。兴全合泰混合份额总额合计为 5,089,658,364.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴全合泰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
<b>一、营业总收入</b>		-682,454,612.91	-1,386,351,687.53
1. 利息收入		467,855.79	882,873.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	467,855.79	882,873.85
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-385,768,052.28	-732,214,849.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-421,254,991.84	-805,810,666.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,684,701.81	20,299,295.60
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	31,802,237.75	53,296,521.62
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	-297,859,144.76	-656,609,344.26
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	704,728.34	1,589,632.31
<b>减：二、营业总支出</b>		70,838,686.43	82,388,357.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	57,412,983.19	66,976,473.21
2. 托管费	6.4.10.2.2	9,568,830.53	11,162,745.52
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,719,885.68	4,110,731.03
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		9.94	67.77
8. 其他费用	6.4.7.23	136,977.09	138,339.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-753,293,299.34	-1,468,740,044.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-753,293,299.34	-1,468,740,044.62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-753,293,299.34	-1,468,740,044.62

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴全合泰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）	5,079,598,630.71	-	2,655,529,333.98	7,735,127,964.69
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）	5,079,598,630.71	-	2,655,529,333.98	7,735,127,964.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,059,733.45	-	694,681,643.71	-684,621,910.26
（一）、综合收益总额	-	-	753,293,299.34	-753,293,299.34
（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）	10,059,733.45	-	58,611,655.63	68,671,389.08



其中：1. 基金申购款	678,526,532.34	-	368,623,577.37	1,047,150,109.71
2. 基金赎回款	-	-	-	-978,478,720.63
	668,466,798.89		310,011,921.74	
(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)	5,089,658,364.16	-	1,960,847,690.27	7,050,506,054.43
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)	5,553,547,594.60	-	5,673,219,955.16	11,226,767,549.76
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)	5,553,547,594.60	-	5,673,219,955.16	11,226,767,549.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
	176,491,072.50	-	1,563,045,987.08	1,739,537,059.58
(一)、综合收益总额	-	-	-	-
			1,468,740,044.62	1,468,740,044.62
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-94,305,942.46	-270,797,014.96
	176,491,072.50			

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	722,568,582.13	-	463,848,237.72	1,186,416,819.85
2. 基金赎回款	- 899,059,654.63	-	- 558,154,180.18	- 1,457,213,834.81
(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)	5,377,056,522.10	-	4,110,173,968.08	9,487,230,490.18

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

兴全合泰混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于准予兴全合泰混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2019]1340号文)的核准,由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》等相关法规和《兴全合泰混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2019年10月17日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为5,939,822,781.28份基金份额。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《兴全合泰混合型证券投资基金基金合同》和《兴全合泰混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,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发行的股票及存托凭证）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、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、证券公司发行的短期债券、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的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 50%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金业绩比较基准为：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%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### (1) 主要税项说明

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- (a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。
- (b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

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

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

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

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

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

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 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	269,341,402.67
等于：本金	269,315,980.27
加：应计利息	25,422.40
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	269,341,402.67

##### 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	7,197,705,383.86	-	6,392,947,209.64	- 804,758,174.22	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,826,200.00	3,386.82	5,804,937.80	975,350.98
	银行间市场	449,166,600.00	6,082,397.26	455,902,397.26	653,400.00
	合计	453,992,800.00	6,085,784.08	461,707,335.06	1,628,750.98
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	7,651,698,183.86	6,085,784.08	6,854,654,544.70	-	

				803,129,423.24
--	--	--	--	----------------

### 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

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

注：无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内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：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 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：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,016.30
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,410,587.91
其中：交易所市场	5,410,587.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	5,511,783.16

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 兴全合泰混合 A

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	4,264,554,868.17	4,264,554,868.17
本期申购	450,992,753.75	450,992,753.75
本期赎回（以“-”号填列）	-535,442,113.22	-535,442,113.22
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	4,180,105,508.70	4,180,105,508.70

## 兴全合泰混合 C

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	815,043,762.54	815,043,762.54
本期申购	227,533,778.59	227,533,778.59
本期赎回（以“-”号填列）	-133,024,685.67	-133,024,685.67
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	909,552,855.46	909,552,855.46

注：此处申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。



## 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

兴全合泰混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,766,799,544.38	-517,492,332.34	2,249,307,212.04
本期利润	-375,315,999.78	-253,966,720.69	-629,282,720.47
本期基金份额交易产生的变动数	-42,383,375.04	55,562,777.72	13,179,402.68
其中：基金申购款	292,535,315.94	-29,562,081.14	262,973,234.80
基金赎回款	-334,918,690.98	85,124,858.86	-249,793,832.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,349,100,169.56	-715,896,275.31	1,633,203,894.25

兴全合泰混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	502,237,982.62	-96,015,860.68	406,222,121.94
本期利润	-80,118,154.80	-43,892,424.07	-124,010,578.87
本期基金份额交易产生的变动数	57,139,024.27	-11,706,771.32	45,432,252.95
其中：基金申购款	136,433,398.90	-30,783,056.33	105,650,342.57
基金赎回款	-79,294,374.63	19,076,285.01	-60,218,089.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	479,258,852.09	-151,615,056.07	327,643,796.02

## 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	320,594.09	
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	134,482.16	
其他	12,779.54	
合计	467,855.79	

注：其他存款利息收入为存出保证金利息收入和基金申购款利息收入。

## 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	-421,254,991.84
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	-421,254,991.84

#### 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	7,579,477,773.58
减：卖出股票成本总额	7,980,794,393.60
减：交易费用	19,938,371.82
买卖股票差价收入	-421,254,991.84

#### 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	3,684,701.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	3,684,701.81

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 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：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**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：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	31,802,237.75
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	31,802,237.75

## 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	-297,859,144.76
股票投资	-299,626,701.54
债券投资	1,767,556.78
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	-297,859,144.76

## 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	682,381.85
基金转换费收入	22,346.49
合计	704,728.34

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	28,798.14
账户维护费	9,000.00
合计	136,977.09

## 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 1.50% 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、基金销售机构、基金注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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	1,174,413,932.33	7.81	2,411,348,092.40	18.67

#### 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未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期及上年度可比期间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	1,106,699.94	11.07	409,651.80	7.57
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	2,245,040.89	25.35	605,000.69	14.48

## 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	57,412,983.19	66,976,473.21
其中：支付销售机构的客户维护 费	22,162,053.54	25,030,087.25

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 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×1.50%/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	9,568,830.53	11,162,745.52

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

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C	合计
兴业证券	-	252,441.33	252,441.33

兴证全球基金	-	142,826.86	142,826.86
招商银行	-	542,311.21	542,311.21
合计	-	937,579.40	937,579.40
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C	合计
兴业证券	-	317,454.46	317,454.46
兴证全球基金	-	204,935.01	204,935.01
招商银行	-	441,018.97	441,018.97
合计	-	963,408.44	963,408.44

注：本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。使用计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×年销售服务费率/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：报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

##### 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

## 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 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
招商银行	269,341,402.67	320,594.09	590,908,050.00	711,700.70

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

## 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
00128	陕	202	6个月	新	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-



6	西能源	3年 3月 31日		股 流 通 受 限						
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	海森药业	2023年 3月 30日	6个月	新 股 流 通 受 限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
002607	中公教育	2023年 6月 7日	6个月	大 宗 交 易 购 入 流 通 受	4.53	4.36	7,800,000	35,334,000.00	34,008,000.00	-

				限						
300203	聚光科技	2023年1月6日	6个月	大宗交易购入流通受限	32.22	20.07	230,000	7,410,600.00	4,616,100.00	-
300203	聚光科技	2023年3月16日	6个月	大宗交易购入流通受限	28.79	19.45	330,000	9,500,700.00	6,418,500.00	-
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	1个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
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	-

				限						
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	海科新源	2023年6月29日	1个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
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	-
30133	德	202	6个月	新	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-

2	尔玛	3 年 5 月 9 日		股 流 通 受 限						
30133 7	亚华 电子	202 3 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	-
30135 7	北方 长龙	202 3 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	-
30135 8	湖南 裕能	202 3 年 2 月 1 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
30137 6	致欧 科技	202 3 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	-
30138 2	蜂助 手	202 3 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	-
30138 7	光大 同创	202 3 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	-
30142 8	世纪 恒	202 3 年 5 月	6 个月	新 股 流	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-

	通	10 日		通 受 限						
30143 9	泓 淋 电 力	202 3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	-
30148 8	豪 恩 汽 电	202 3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	-
30148 8	豪 恩 汽 电	202 3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	-
60106 5	江 盐 集 团	202 3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	-
60113 3	柏 诚 股 份	202 3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	-
60312 5	常 青 科 技	202 3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	-
60313 7	恒 尚 节 能	202 3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	-
603786	科博达	2023年1月5日	6个月	大宗交易购入流通受限	62.00	65.02	680,000	42,160,000.00	44,213,600.00	-
603997	继峰股份	2023年6月15日	6个月	大宗交易购入流通受限	13.02	13.40	1,800,000	23,436,000.00	24,120,000.00	-
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	-
688307	中润光学	2023年2月8日	6个月	新股流通受限	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-

				限						
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	-
68847	友	202	6个月	新	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-

9	车科技	3 年 5 月 4 日		股 流 通 受 限						
68848 4	南 芯 科 技	202 3 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	-
68848 5	九 州 一 轨	202 3 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	-
68850 7	索 辰 科 技	202 3 年 4 月 10 日	6 个月	新 股 流 通 受 限	245.5 6	122.1 1	150	36,834.00	18,316.50	-
68850 7	索 辰 科 技	202 3 年 6 月 20 日	4 个月	新 股 流 通 受 限 - 转 增	-	122.1 1	72	-	8,791.92	注
68851 2	慧 智 微	202 3 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	-
68853 5	华 海 诚 科	202 3 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	国科军工	2023年6月14日	6个月	新股流通受限	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
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	6个月	新股流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688603	天承	2023年	1个月内	新股	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-

	科技	6月30日	(含)	流通受限						
688617	惠泰医疗	2023年3月6日	6个月	大宗交易购入流通受限	332.94	359.13	27,000	8,989,380.00	9,696,510.00	-
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	-
689009	九号公司	2023年6月15日	6个月	大宗交易购入流通受限	32.72	34.13	1,100,000	35,992,000.00	37,543,000.00	-
689009	九号	2023年	6个月	大宗	34.32	34.11	720,000	24,710,400.00	24,559,200.00	-

	公司	6月 29 日		交易 购 入 流 通 受 限						
--	----	---------------	--	----------------------------------	--	--	--	--	--	--

注：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。

#### 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：本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

#### 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	-	-
AAA 以下	5,804,937.80	2,863,382.67
未评级	-	-
合计	5,804,937.80	2,863,382.67

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

#### 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 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 202 3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	269,341,402.67	-	-	-	-	269,341,402.67
结算备付金	7,541,949.62	-	-	-	-	7,541,949.62
存出保证金	1,117,136.98	-	-	-	-	1,117,136.98
交易性金融资产	-	455,902,397.26	-	5,804,937.80	6,392,947,209.64	6,854,654,544.70
应收股利	-	-	-	-	1,320,677.76	1,320,677.76
应收申购款	43,978.86	-	-	-	1,930,254.13	1,974,232.99
应收清算款	-	-	-	-	20,592,861.91	20,592,861.91
资产总计	278,044,468.13	455,902,397.26	-	5,804,937.80	6,416,791,003.44	7,156,542,806.63
负债						
应付	-	-	-	-	7,679,818.42	7,679,818.42

赎回款						
应付管理人报酬	-	-	-	-	8,522,382.17	8,522,382.17
应付托管费	-	-	-	-	1,420,397.03	1,420,397.03
应付清算款	-	-	-	-	82,309,922.19	82,309,922.19
应付销售服务费	-	-	-	-	592,427.73	592,427.73
应交税费	-	-	-	-	21.50	21.50
其他负债	-	-	-	-	5,511,783.16	5,511,783.16
负债总计	-	-	-	-	106,036,752.20	106,036,752.20
利率敏感度缺	278,044,468.13	455,902,397.26	-	5,804,937.80	6,310,754,251.24	7,050,506,054.43

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	112,544,731.11	-	-	-	-	-	112,544,731.11
结算 备付 金	8,495,689.69	-	-	-	-	-	8,495,689.69
存出 保证 金	1,363,991.70	-	-	-	-	-	1,363,991.70
交易 性金 融资 产	-	-	450,825,410.96	-	2,863,382.67	7,203,811,331.85	7,657,500,125.48
应收 申购 款	150,489.54	-	-	-	-	2,424,077.23	2,574,566.77
资产 总计	122,554,902.04	-	450,825,410.96	-	2,863,382.67	7,206,235,409.08	7,782,479,104.75
负债							



应付赎回款	-	-	-	-	5,656,289.13	5,656,289.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	10,130,544.00	10,130,544.00
应付托管费	-	-	-	-	1,688,424.03	1,688,424.03
应付清算款	-	-	-	-	24,354,014.88	24,354,014.88
应付销售服务费	-	-	-	-	633,924.51	633,924.51
应交税费	-	-	-	-	12.04	12.04
其他负债	-	-	-	-	4,887,931.47	4,887,931.47
负债总计	-	-	-	-	47,351,140.06	47,351,140.06
利率敏感	122,554,902.04	-	450,825,410.96	2,863,382.67	7,158,884,269.02	7,735,127,964.69

度 缺 口						
-------------	--	--	--	--	--	--

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)
	1. 市场利率下降1%	824,225.43	3,032,001.61
	2. 市场利率上升1%	-821,216.13	-2,991,535.31

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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，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。

本报告期末基金各外币资产负债项目汇率风险敞口如下。本出于列报考虑，风险敞口金额以人民币列示，以资产负债表日即期汇率折算。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-	332,304,159.76	-	332,304,159.76
资产合计	-	332,304,159.76	-	332,304,159.76
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	-	332,304,159.76	-	332,304,159.76
项目	上年度末 2022 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	-	836,149,509.73	-	836,149,509.73
资产合计	-	836,149,509.73	-	836,149,509.73
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	-	836,149,509.73	-	836,149,509.73

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。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他变量不变		
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）
	所有外币对人民币升值 5%	16,615,207.99	41,807,475.49
	所有外币对人民币贬值 5%	-16,615,207.99	-41,807,475.49

#### 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 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	6,392,947,209.64	90.67	7,203,811,331.85	93.13
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	461,707,335.06	6.55	453,688,793.63	5.87
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	6,854,654,544.70	97.22	7,657,500,125.48	99.00

#### 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）
	业绩比较基准上升 10%	646,085,757.22	722,461,193.23
	业绩比较基准下降 10%	-646,085,757.22	-722,461,193.23

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

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	6,211,835,784.93	6,605,398,253.21
第二层次	456,351,280.96	450,825,410.96
第三层次	186,467,478.81	601,276,461.31
合计	6,854,654,544.70	7,657,500,125.48

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2023 年 06 月 30

日：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,392,947,209.64	89.33
	其中：股票	6,392,947,209.64	89.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	461,707,335.06	6.45
	其中：债券	461,707,335.06	6.45
	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	276,883,352.29	3.87
8	其他各项资产	25,004,909.64	0.35
9	合计	7,156,542,806.63	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 332,304,159.76 元，占净值比例 4.71%。

### 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	24,201,560.55	0.34
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,770,824,220.35	81.85
D	电力、热力、燃气及水生产和	35,447.47	0.00

	供应业		
E	建筑业	27,764,900.15	0.39
F	批发和零售业	38,587.92	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,868,557.84	1.35
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	64,522,707.00	0.92
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	78,332,760.00	1.11
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,060,643,049.88	85.96

### 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	60,661,420.64	0.86
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	101,699,884.16	1.44
工业	-	-
信息技术	14,936,573.87	0.21
通信服务	155,006,281.09	2.20
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	332,304,159.76	4.71

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

### 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	300054	鼎龙股份	19,576,316	484,122,294.68	6.87
2	603799	华友钴业	7,541,641	346,236,738.31	4.91
3	603786	科博达	5,088,005	333,819,528.50	4.73
4	688033	天宜上佳	16,337,389	312,370,877.68	4.43

5	600399	抚顺特钢	29,295,835	298,817,517.00	4.24
6	688005	容百科技	5,494,074	296,789,877.48	4.21
7	688598	金博股份	1,591,927	273,015,480.50	3.87
8	600416	湘电股份	13,087,476	249,839,916.84	3.54
9	002831	裕同科技	8,218,074	200,438,824.86	2.84
10	600426	华鲁恒升	6,387,099	195,636,842.37	2.77
11	300679	电连技术	5,165,067	170,705,464.35	2.42
12	300750	宁德时代	694,831	158,970,384.49	2.25
13	603267	鸿远电子	2,418,397	157,921,324.10	2.24
14	603995	甬金股份	6,397,572	152,965,946.52	2.17
15	601799	星宇股份	1,220,694	150,877,778.40	2.14
16	603901	永创智能	9,252,146	134,711,245.76	1.91
17	000733	振华科技	1,313,200	125,870,220.00	1.79
18	301031	中熔电气	887,217	120,404,219.07	1.71
19	603501	韦尔股份	1,217,926	119,405,465.04	1.69
20	603678	火炬电子	3,444,354	118,692,438.84	1.68
21	603085	天成自控	11,835,979	117,649,631.26	1.67
22	002049	紫光国微	1,240,814	115,705,905.50	1.64
23	600885	宏发股份	3,056,974	97,364,621.90	1.38
24	300408	三环集团	3,001,491	88,093,760.85	1.25
25	00700	腾讯控股	272,500	83,311,034.78	1.18
26	002607	中公教育	17,230,800	78,332,760.00	1.11
27	300354	东华测试	1,669,659	74,633,757.30	1.06
28	01024	快手-W	1,452,143	71,695,246.31	1.02
29	002050	三花智控	2,338,949	70,776,596.74	1.00
30	002027	分众传媒	9,474,700	64,522,707.00	0.92
31	689009	九号公司	1,820,000	62,102,200.00	0.88
32	002078	太阳纸业	5,804,599	62,051,163.31	0.88
33	000625	长安汽车	4,500,295	58,188,814.35	0.83
34	06699	时代天使	860,800	57,975,430.05	0.82
35	02333	长城汽车	5,502,824	45,509,238.23	0.65
36	02269	药明生物	1,260,345	43,633,583.76	0.62
37	002371	北方华创	133,800	42,501,570.00	0.60
38	603032	德新科技	1,213,708	41,921,474.32	0.59
39	603659	璞泰来	1,062,025	40,590,595.50	0.58
40	300450	先导智能	1,100,121	39,791,376.57	0.56
41	002415	海康威视	1,195,200	39,573,072.00	0.56
42	600893	航发动力	908,542	38,394,984.92	0.54
43	002389	航天彩虹	1,483,026	32,938,007.46	0.47
44	601966	玲珑轮胎	1,464,610	32,543,634.20	0.46
45	000534	万泽股份	1,818,917	30,503,238.09	0.43
46	688099	晶晨股份	360,642	30,409,333.44	0.43
47	603063	禾望电气	940,400	28,917,300.00	0.41



48	600760	中航沈飞	598,164	26,917,380.00	0.38
49	002444	巨星科技	1,218,702	26,665,199.76	0.38
50	601702	华峰铝业	1,898,989	25,978,169.52	0.37
51	002410	广联达	754,010	24,497,784.90	0.35
52	002714	牧原股份	574,177	24,201,560.55	0.34
53	603997	继峰股份	1,800,000	24,120,000.00	0.34
54	300257	开山股份	1,469,122	22,286,580.74	0.32
55	002223	鱼跃医疗	580,457	20,890,647.43	0.30
56	300203	聚光科技	1,040,000	20,764,200.00	0.29
57	688083	中望软件	141,924	20,563,368.36	0.29
58	300454	深信服	169,760	19,225,320.00	0.27
59	000768	中航西飞	704,400	18,842,700.00	0.27
60	688114	华大智造	206,615	17,884,594.40	0.25
61	601668	中国建筑	2,738,600	15,719,564.00	0.22
62	300811	铂科新材	258,540	15,367,617.60	0.22
63	09992	泡泡玛特	943,421	15,152,182.41	0.21
64	300627	华测导航	460,400	14,949,188.00	0.21
65	06610	飞天云动	9,474,000	14,936,573.87	0.21
66	000032	深桑达 A	365,800	12,034,820.00	0.17
67	688617	惠泰医疗	27,000	9,696,510.00	0.14
68	002311	海大集团	142,100	6,655,964.00	0.09
69	300769	德方纳米	13,260	1,461,649.80	0.02
70	688295	中复神鹰	13,998	513,446.64	0.01
71	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.00
72	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
73	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
74	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.00
75	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
76	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
77	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.00
78	09996	沛嘉医疗-B	16,000	90,870.35	0.00
79	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
80	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
81	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.00
82	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
83	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
84	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
85	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
86	001269	欧晶科技	764	56,176.92	0.00
87	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.00
88	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
89	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
90	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00

91	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
92	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
93	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
94	301391	卡莱特	247	28,940.99	0.00
95	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
96	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
97	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
98	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
99	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
100	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
101	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
102	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
103	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
104	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
105	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
106	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
107	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
108	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
109	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
110	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
111	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
112	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
113	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
114	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
115	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
116	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
117	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
118	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
119	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
120	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
121	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
122	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
123	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
124	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
125	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
126	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
127	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
128	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	688005	容百科技	369,792,916.53	4.78
2	002050	三花智控	291,798,774.75	3.77
3	300750	宁德时代	261,720,012.49	3.38
4	600416	湘电股份	234,863,482.97	3.04
5	00700	腾讯控股	188,082,785.25	2.43
6	002415	海康威视	184,600,083.50	2.39
7	600399	抚顺特钢	139,615,124.18	1.80
8	603501	韦尔股份	138,288,335.48	1.79
9	688598	金博股份	135,270,172.11	1.75
10	603786	科博达	133,494,127.07	1.73
11	000733	振华科技	128,365,534.94	1.66
12	01024	快手-W	125,197,817.52	1.62
13	002049	紫光国微	124,737,788.82	1.61
14	300054	鼎龙股份	110,025,974.51	1.42
15	002384	东山精密	109,791,805.96	1.42
16	002142	宁波银行	108,653,056.17	1.40
17	688033	天宜上佳	105,152,016.15	1.36
18	688008	澜起科技	104,044,376.36	1.35
19	002607	中公教育	101,782,441.00	1.32
20	02333	长城汽车	67,544,377.44	0.87
20	601633	长城汽车	28,004,041.00	0.36

注：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	688005	容百科技	319,457,987.87	4.13
2	300054	鼎龙股份	288,263,613.89	3.73
3	002050	三花智控	275,329,879.43	3.56
4	688008	澜起科技	268,158,843.69	3.47
5	603799	华友钴业	252,333,961.39	3.26
6	689009	九号公司	248,633,756.73	3.21
7	01024	快手-W	223,675,678.83	2.89
8	002142	宁波银行	177,377,131.35	2.29
9	600031	三一重工	172,860,152.99	2.23
10	002415	海康威视	146,994,683.76	1.90
11	02269	药明生物	144,584,773.60	1.87

12	002384	东山精密	144,539,489.97	1.87
13	02333	长城汽车	115,114,045.37	1.49
13	601633	长城汽车	22,194,536.00	0.29
14	603267	鸿远电子	135,137,518.34	1.75
15	601890	亚星锚链	128,261,444.26	1.66
16	688598	金博股份	124,602,778.55	1.61
17	03690	美团-W	123,152,805.80	1.59
18	601615	明阳智能	119,530,346.38	1.55
19	300750	宁德时代	115,091,727.25	1.49
20	00700	腾讯控股	97,500,483.03	1.26

注：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	7,469,556,972.93
卖出股票收入（成交）总额	7,579,477,773.58

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

#### 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	455,902,397.26	6.47
	其中：政策性金融债	455,902,397.26	6.47
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）	5,804,937.80	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	461,707,335.06	6.55

#### 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

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	4,500,000	455,902,397.26	6.47
2	127085	韵达转债	25,662	3,039,035.36	0.04
3	113661	福 22 转债	20,230	2,448,778.32	0.03
4	113654	永 02 转债	2,370	317,124.12	0.00

### 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。

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 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

本基金本报告期内未持有国债期货，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，并且未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	1,117,136.98
2	应收清算款	20,592,861.91
3	应收股利	1,320,677.76
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,974,232.99

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,004,909.64

#### 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	113661	福 22 转债	2,448,778.32	0.03
2	113654	永 02 转债	317,124.12	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	603786	科博达	44,213,600.00	0.63	大宗交易购入流通受限

#### 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 (%)
兴全合泰混合 A	252,132	16,579.04	145,412,838.53	3.48	4,034,692,670.17	96.52
兴全合泰混合 C	100,765	9,026.48	13,283,524.71	1.46	896,269,330.75	98.54
合计	352,897	14,422.50	158,696,363.24	3.12	4,930,962,000.92	96.88

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）。

### 8.2 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	兴全合泰混合 A	18,483,394.20	0.4422
	兴全合泰混合 C	519,424.19	0.0571
	合计	19,002,818.39	0.3734

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

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴全合泰混合 A	>100
	兴全合泰混合 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全合泰混合 A	>100
	兴全合泰混合 C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C
基金合同生效日 (2019年10月17日)基金份额总额	5,223,614,215.98	716,208,565.30
本报告期初基金份额总额	4,264,554,868.17	815,043,762.54
本报告期基金总申购份额	450,992,753.75	227,533,778.59
减：本报告期基金总赎回份额	535,442,113.22	133,024,685.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,180,105,508.70	909,552,855.46

## § 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

本基金自 2019 年起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

## 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：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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	2,467,886,306.80	16.41	1,705,694.34	17.06	-
国盛证券	2	1,707,674,466.38	11.36	1,107,691.96	11.08	-
天风证券	2	1,415,214,077.98	9.41	912,393.02	9.13	-
东方财富	2	1,333,326,056.65	8.87	587,722.98	5.88	-
东吴证券	2	1,181,499,335.74	7.86	750,417.93	7.51	-
兴业证券	3	1,174,413,932.33	7.81	1,106,699.94	11.07	-
国泰君安	2	1,167,055,4	7.76	857,628.51	8.58	-



		60.54				
国金证券	2	961,735,841 .00	6.40	612,304.73	6.12	-
中信建投 证券	5	613,428,614 .29	4.08	391,547.45	3.92	-
国信证券	2	608,843,870 .32	4.05	391,503.81	3.92	-
东方证券	1	601,822,053 .29	4.00	440,114.36	4.40	-
中泰证券	2	296,304,576 .65	1.97	189,390.14	1.89	-
申万宏源 证券	2	246,044,608 .51	1.64	108,327.07	1.08	-
华福证券	1	231,208,771 .76	1.54	147,425.26	1.47	-
长江证券	2	214,793,335 .24	1.43	135,592.64	1.36	-
中金公司	2	200,292,574 .06	1.33	133,277.13	1.33	-
华创证券	1	169,360,196 .18	1.13	123,851.51	1.24	-
民生证券	1	143,888,438 .92	0.96	105,226.26	1.05	-
国都证券	2	135,211,306 .77	0.90	85,359.29	0.85	-
华泰证券	2	104,838,645 .35	0.70	66,370.10	0.66	-
南京证券	1	61,804,193. 06	0.41	39,611.34	0.40	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	4	-	-	-	-	-

中信证券	5	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中金公	-	-	-	-	-	-

司						
华创证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
爱建证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信证 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	关于兴全合泰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	2023-02-01

2	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	2023-02-28
3	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停接受大额申购（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	2023-03-01
4	关于增加渤海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	2023-03-10
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	2023-03-23
6	关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023-05-05
7	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2023-06-14

## § 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

根据本基金的基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《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 日起将基金管理费年费率调整为 1.2%，托管费年费率调整为 0.2%。

## § 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泰混合型证券投资基金注册的批复
- 2、《兴全合泰混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全合泰混合型证券投资基金托管协议》

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 6、关于申请募集注册兴全合泰混合型证券投资基金的法律意见书
- 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

2023 年 8 月 31 日