

兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）  
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
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 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	20
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
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 .....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
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 .....	48
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 .....	48

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	48
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	48
7.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.11	本报告期投资基金情况	48
7.12	投资组合报告附注	错误!未定义书签。
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>57</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>59</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>59</b>
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	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	59
10.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.9	其他重大事件	61
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>62</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	62
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>63</b>
12.1	备查文件目录	63
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	兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）	
基金简称	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF	
基金主代码	015377	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 22 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	908,709,672.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
下属分级基金的交易代码	015377	015378
报告期末下属分级基金的份额总额	537,645,512.80 份	371,064,160.01 份

注：1、本基金每份基金份额最短持有期为 6 个月。

2、若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否暂停申购及赎回业务，具体以届时提前发布的公告为准。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可以细分为大类资产配置策略、优选基金策略、股票投资策略、存托凭证的投资策略、港股投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、公募 REITs 投资策略等。
业绩比较基准	中证普通债券型基金指数收益率×85%+中证偏股型基金指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。基金管理人对本基金的风险评级为 R2。 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	上海浦东发展银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	杨卫东	朱萍
	联系电话	021-20398888	021-31888888
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95528
传真		021-20398988	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	上海市中山东一路 12 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码		201204	200126
法定代表人		杨华辉	郑杨

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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)	
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
本期已实现收益	10,166,189.38	6,819,359.05
本期利润	16,425,642.02	11,681,792.19
加权平均基金份 额本期利润	0.0257	0.0247
本期加权平均净 值利润率	2.49%	2.41%
本期基金份额净 值增长率	2.38%	2.26%
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	15,715,498.85	9,699,134.17
期末可供分配基金份额利润	0.0292	0.0261
期末基金资产净值	558,688,821.24	384,438,509.67
期末基金份额净值	1.0391	1.0360
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	3.91%	3.60%

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

兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.49%	0.08%	0.37%	0.09%	0.12%	-0.01%
过去三个月	0.79%	0.07%	0.33%	0.08%	0.46%	-0.01%
过去六个月	2.38%	0.07%	1.48%	0.08%	0.90%	-0.01%
过去一年	2.42%	0.09%	0.32%	0.10%	2.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	3.91%	0.08%	2.66%	0.11%	1.25%	-0.03%

兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C

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	0.48%	0.08%	0.37%	0.09%	0.11%	-0.01%
过去三个月	0.72%	0.07%	0.33%	0.08%	0.39%	-0.01%
过去六个月	2.26%	0.07%	1.48%	0.08%	0.78%	-0.01%
过去一年	2.17%	0.09%	0.32%	0.10%	1.85%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	3.60%	0.08%	2.66%	0.11%	0.94%	-0.03%

注：1、本基金业绩比较基准为：中证普通债券型基金指数收益率×85%+中证偏股型基金指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%。采用该业绩比较基准主要基于以下考虑：中证普通债券型基金指数由中证指数有限公司编制，选取所有纯债型基金以及基金合同规定可适当投资可转债、但不可投资股票二级市场的债券型基金，采用净值规模加权，与本基金投资目标相匹配，适合作为本基金投资债券型基金的业绩比较基准。本基金投资于债券型证券投资基金的比例不低于本基金资产的80%，因此本基金业绩比较基准中的85%选择了中证普通债券型基金指数收益率。

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：

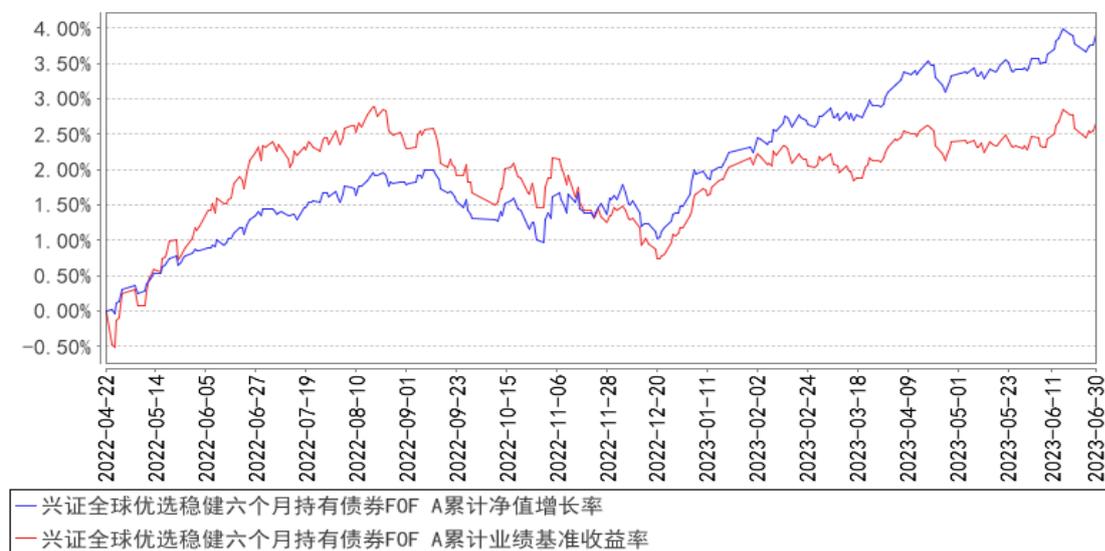
$$\text{Return } t = 85\% \times (\text{中证普通债券型基金指数收益率 } t / \text{中证普通债券型基金指数收益率 } t-1 - 1) + 10\% \times (\text{中证偏股型基金指数收益率 } t / \text{中证偏股型基金指数收益率 } t-1 - 1) + 5\% \times (\text{银行活期存款利率 (税后) } t / \text{银行活期存款利率 (税后) } t-1 - 1)$$

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

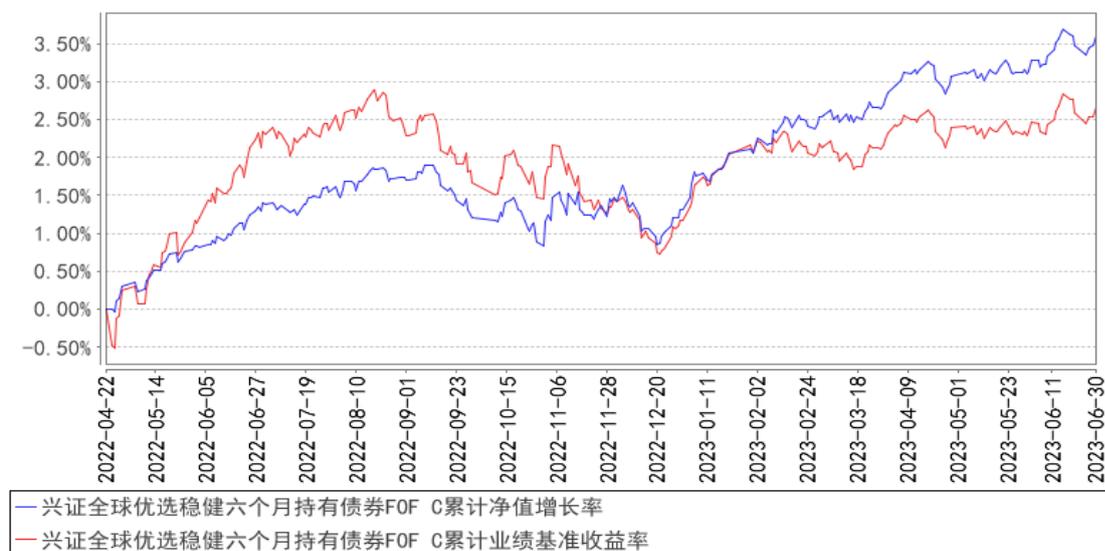
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$ 表示时间截至日。

### 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

兴证全球优选稳健六个月持有债券FOF A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴证全球优选稳健六个月持有债券FOF 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《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2022 年 04 月 22 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		
林国怀	FOF 投资与金融工程部总监、养老金管理部总监，兴全安泰平衡养老三年持有混合 FOF、兴全优选进取三个月持有混合 FOF、兴全安泰积极养老五年持有混合	2022 年 4 月 22 日	-	16 年	硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资产管理中心基金组合投资经理，泰康资产管理有限公司执行总监，天安人寿资产管理中心权益投资部经理，兴证全球基金管理有限公司兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理。

	<p>发起式 FOF、兴证全球优选平衡三个月持有混合 FOF、兴证全球安悦稳健养老目标一年持有混合 FOF、兴证全球积极配置三年封闭运作混合 FOF-LOF、兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF、兴证全球优选积极三个月持有混合 FOF 基金经理</p>				
<p>刘潇</p>	<p>兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理、兴证全球安悦平衡养老目标</p>	<p>2022 年 6 月 16 日</p>	<p>-</p>	<p>11 年</p>	<p>硕士。历任泰康资产管理有限责任公司基金研究员、基金投资总监，腾讯科技（北京）有限公司产品研究副总监，兴证全球基金管理有限公司投资经理。</p>

	三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理				
丁凯琳	兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）、兴证全球优选积极三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理	2023 年 1 月 4 日	-	10 年	硕士，历任美国芝加哥商品交易所量化风险管理经理、兴证全球基金管理有限公司研究员、基金经理助理、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、兴证全球优选平衡三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理和兴证全球积极配置三年封闭运作混合型基金中基金（FOF-LOF）基金经理。

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、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、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 A 股市场呈现结构性行情，尽管上证综指上涨 3.65%，但市场内部分化较为明显。从主流宽基指数看，中证 1000、上证红利、科创 50 指数表现较好，分别上涨 5.10%、5.03% 和 4.71%，而创业板 50、创业板指、上证 50 指数下跌幅度较大，分别下跌 9.33%、5.61% 和 5.43%。从申万一级行业表现来看，受益于 AI 行情推动的 TMT 板块涨幅较大，尤其是通信、传媒行业涨幅均超过 40%，计算机行业涨幅接近 30%，而与宏观经济关联度高的行业表现较为落后，其中商贸零售、房地产和美容护理跌幅最大，分别下跌 23.44%、14.29%、13.61%。从风格指数上来看，中价股表现优于高价股、低价股指数，小盘指数表现优于中、大盘指数，微利股指数优于亏损股、绩优股指数，另外高、低市盈率指数表现优于中市盈率指数，中、低市净率指数优于高市净率指数。上半年债券市场方面表现相对突出，其中，中债总财富指数上涨 2.55%，中债银行间国债财富指数上涨 2.66%，中债企业债总财富指数上涨 3.96%，中证转债指数上涨 3.37%。从基金指数上看，中证偏股基金指数下跌 3.60%，中长期纯债基金指数上涨 2.11%，黄金 ETF 上涨 9.11%，以人民币计价的标普 500ETF 净值上涨 19.81%，纳斯达克 ETF 净值上涨 44.71%。

回顾上半年，本基金主要进行了以下操作：1、权益资产部分，鉴于股票市场处于相对偏低估的位置，组合仓位维持在略高于权益配置中枢的水平；风格上，随着前期成长股的大幅调整，组合逐步切换部分价值类资产至顺周期、泛成长类的基金资产，但组合整体仍然超配在价值风格；从多资产配置的角度，组合还配置了美股基金、港股基金。2、固定收益资产部分，利用信用利差的波动做了相应操作，年初信用利差走阔且经济改善预期明显，组合在债券基金配置上采取了中短久期、多信用的策略；而二季度债券收益率大幅下行、信用利差持续收窄，组合则不断降低了以信用挖掘为主要策略的债券基金品种的配置比例，保持了组合的中短久期配置策略。3、其他资产部分，组合增加配置了黄金资产，我们坚持多资产配置策略，利用大类资产之间的低相关性改善组合波动水平，权益型基金、债券型基金、商品型基金均是我们多资产配置的重要组成部分；4、根据既定的策略参与股票定增、大宗交易、场内折价基金等投资机会，对已解禁的股票进行减

持。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A 的基金份额净值为 1.0391 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.38%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%；截至本报告期末兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C 的基金份额净值为 1.0360 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.26%，同期业绩比较基准收益率为 1.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 A 股市场经历了年初的快速上涨，而在二月后转而下行，主要还是因为投资者们对中国经济复苏的节奏和力度的预期发生了较大的转变，从非常乐观转向了极度低落，从而导致 A 股资产整体走弱，呈现为分化显著的结构行情，而固定收益类资产则获得资金涌入，获得相对较好的收益。

站在当下，我们仍然认为 A 股市场具备较高的配置价值。A 股资产经历了近两年的调整，整体估值已得到了较大消化，目前处于历史相对偏低的水平；从股债性价比模型来看，A 股市场相对于债券市场的投资价值更优。此外，我们认为“政策底”已出现，7 月政治局会议释放了相对积极的信号，我们对中国经济增长的韧性也不应过度悲观。近半年以来，债券市场的绝对收益率和信用利差水平在持续走低，我们会综合考量这类资产的风险和收益来进行组合调整。我们注重多策略、多资产的配置，以此来分散组合的收益来源、优化组合的风险特征，从而实现长期稳健增值的目标。

本基金是一只稳健型的普通 FOF 产品，权益类资产的配置中枢为 10%，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契约要求、保持策略的稳定性，兼顾长期收益率和改善持有人体验，从而陪伴投资者实现财富增值。

#### 4.6 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给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、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》、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由兴证全球基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）

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	15,763,230.71	31,717,579.72
结算备付金		71,363.32	184,605.48
存出保证金		21,193.62	37,735.22
交易性金融资产	6.4.7.2	932,363,018.60	1,428,969,074.67
其中：股票投资		7,163,690.71	18,079,160.18
基金投资		876,174,534.57	1,329,859,010.38
债券投资		49,024,793.32	81,030,904.11
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	-1,084.93	-1,494.01
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		6,264,545.02	4,026,617.34
应收股利		-	158,367.20
应收申购款		1,408,137.61	393,592.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	753.99	762.04
资产总计		955,891,157.94	1,465,486,839.78
<b>负债和净资产</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		-	-
应付赎回款		12,339,885.62	19,954,111.21
应付管理人报酬		176,509.49	296,958.27
应付托管费		74,799.49	127,027.43
应付销售服务费		81,632.15	144,829.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,667.04	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,333.24	146,621.74
负债合计		12,763,827.03	20,669,547.99
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	908,709,672.81	1,424,689,274.88
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	34,417,658.10	20,128,016.91
净资产合计		943,127,330.91	1,444,817,291.79
负债和净资产总计		955,891,157.94	1,465,486,839.78

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A 基金份额净值 1.0391 元，基金份额总额 537,645,512.80 份；兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C 基金份额净值 1.0360 元，基金份额总额 371,064,160.01 份。兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF 份额总额合计为 908,709,672.81 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）

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 4 月 22 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		30,632,985.18	36,365,823.82
1. 利息收入		120,771.06	467,099.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	116,113.48	464,851.08
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		4,657.58	2,247.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,385,680.61	9,244,840.25
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,701,488.95	-56.82
基金投资收益	6.4.7.15	9,577,935.92	1,439,246.44
债券投资收益	6.4.7.16	707,674.32	399,589.53
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-

股利收益	6.4.7.20	7,398,581.42	7,406,061.10
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）	6.4.7.21	11,121,885.78	26,644,465.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	4,647.73	9,418.76
<b>减：二、营业总支出</b>		2,525,550.97	1,920,102.41
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,268,415.02	946,880.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	540,482.51	448,604.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	604,721.35	477,781.86
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	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		4,451.76	0.24
8. 其他费用	6.4.7.25	107,480.33	46,835.61
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		28,107,434.21	34,445,721.41
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		28,107,434.21	34,445,721.41
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		28,107,434.21	34,445,721.41

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）

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）	1,424,689,274. 88	-	20,128,016.91	1,444,817,291.7 9
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,424,689,274.88	-	20,128,016.91	1,444,817,291.79
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	515,979,602.07	-	14,289,641.19	-501,689,960.88
(一)、综合收益总额	-	-	28,107,434.21	28,107,434.21
(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)	515,979,602.07	-	-13,817,793.02	-529,797,395.09
其中：1. 基金申购款	81,839,557.83	-	2,328,780.38	84,168,338.21
2. 基金赎回款	597,819,159.90	-	-16,146,573.40	-613,965,733.30
(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)	908,709,672.81	-	34,417,658.10	943,127,330.91
项目	上年度可比期间			
	2022年4月22日(基金合同生效日)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)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	2,403,241,233.	-	-	2,403,241,233.8

资产(基金净值)	84			4
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	27,749,626.27	-	34,768,265.63	62,517,891.90
(一)、综合收益总额	-	-	34,445,721.41	34,445,721.41
(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)	27,749,626.27	-	322,544.22	28,072,170.49
其中：1. 基金申购款	27,749,626.27	-	322,544.22	28,072,170.49
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,430,990,860.11	-	34,768,265.63	2,465,759,125.74

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

兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）（以下简称“本基金”），系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]381号文的核准予

以公开募集，本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集基金份额为 2,403,241,233.84 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(22)第 00185 号验资报告。基金合同于 2022 年 4 月 22 日正式生效，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”））、国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括主板、创业板及其他中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金的业绩比较基准为中证普通债券型基金指数收益率×85%+中证偏股型基金指数收益率×10%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。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

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本基金在本报告期间无会计政策变更。

### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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	15,763,230.71
等于：本金	15,758,857.10
加：应计利息	4,373.61
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	15,763,230.71

## 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	5,999,995.62	-	7,163,690.71	1,163,695.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	30,400.44	8,265,560.44	20,502.49
	银行间市场	40,267,280.00	503,232.88	-11,280.00
	合计	48,481,937.51	533,633.32	49,024,793.32
资产支持证券	-	-	-	-
基金	861,366,214.18	-	876,174,534.57	14,808,320.39
其他	-	-	-	-
合计	915,848,147.31	533,633.32	932,363,018.60	15,981,237.97

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：无。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

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	-1,084.93	-
银行间市场	-	-
合计	-1,084.93	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本报告期末本基金无债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本报告期内本基金未发生债权投资减值准备。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	753.99
待摊费用	-
合计	753.99

## 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,552.79
其中：交易所市场	2,127.79
银行间市场	425.00
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	89,333.24

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF 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	795,074,332.68	795,074,332.68
本期申购	60,500,918.64	60,500,918.64
本期赎回（以“-”号填列）	-317,929,738.52	-317,929,738.52
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	537,645,512.80	537,645,512.80

## 兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF 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	629,614,942.20	629,614,942.20
本期申购	21,338,639.19	21,338,639.19
本期赎回（以“-”号填列）	-279,889,421.38	-279,889,421.38

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	371,064,160.01	371,064,160.01

#### 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

兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,300,568.59	1,551,598.72	11,852,167.31
本期利润	10,166,189.38	6,259,452.64	16,425,642.02
本期基金份额交易产生的变动数	-4,751,259.12	-2,483,241.77	-7,234,500.89
其中：基金申购款	1,146,376.52	576,920.07	1,723,296.59
基金赎回款	-5,897,635.64	-3,060,161.84	-8,957,797.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,715,498.85	5,327,809.59	21,043,308.44

兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,041,413.68	1,234,435.92	8,275,849.60
本期利润	6,819,359.05	4,862,433.14	11,681,792.19
本期基金份额交易产生的变动数	-4,161,638.56	-2,421,653.57	-6,583,292.13
其中：基金申购款	386,353.96	219,129.83	605,483.79
基金赎回款	-4,547,992.52	-2,640,783.40	-7,188,775.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,699,134.17	3,675,215.49	13,374,349.66

#### 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	110,897.61
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	3,320.17
其他	1,895.70
合计	116,113.48

## 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	1,701,488.95
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	1,701,488.95

## 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	20,107,352.40
减：卖出股票成本总额	18,371,479.09
减：交易费用	34,384.36
买卖股票差价收入	1,701,488.95

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

## 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	679,312,135.93
减：卖出/赎回基金成本总额	669,288,199.63
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	37,093.72
减：交易费用	408,906.66
基金投资收益	9,577,935.92

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 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	647,631.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券	60,042.47

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	707,674.32

#### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	84,679,703.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	83,138,711.33
减：应计利息总额	1,480,142.43
减：交易费用	807.05
买卖债券差价收入	60,042.47

#### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 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	11,390.70
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	7,387,190.72
合计	7,398,581.42

## 6.4.7.21 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	11,121,885.78
股票投资	1,456,014.00
债券投资	-24,617.51
资产支持证券投资	-
基金投资	9,690,489.29
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	11,121,885.78

## 6.4.7.22 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	-
其他	4,647.73
合计	4,647.73

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	5,308.38
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	2,275,335.88
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	564,526.81

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.25 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	11,699.88
账户维护费	9,000.00
合计	107,480.33

#### 6.4.7.26 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

## 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4月22日（基金合同生效日）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	13,633,184.26	67.80	-	-

## 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

## 6.4.10.1.4 基金交易

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4月22日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）	成交金额	占当期基金成交总额的比例（%）
兴业证券	21,680,128.48	38.25	16,126,472.30	48.76

## 6.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	8,606.62	67.80	698.32	32.82
关联方名称	上年度可比期间 2022年4月22日（基金合同生效日）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（%）
-	-	-	-	-

#### 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4月22日（基金 合同生效日）至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,268,415.02	946,880.62
其中：支付销售机构的客户维护 费	712,888.54	582,657.39

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.3%的年费率计提，但本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。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扣除本基金投资于本管理人所管理的基金的部分×0.3%/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4月22日（基金 合同生效日）至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	540,482.51	448,604.08

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%的年费率计提，但本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。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扣除本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分×0.1%/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		
	兴证全球优选稳健六个 月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个 月持有债券 FOF C	合计
浦发银行	-	47,725.90	47,725.90

兴业证券	-	17,479.53	17,479.53
兴证全球基金	-	-	-
合计	-	65,205.43	65,205.43
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C	合计
浦发银行	-	45,979.79	45,979.79
兴业证券	-	15,383.03	15,383.03
兴证全球基金	-	1,132.45	1,132.45
合计	-	62,495.27	62,495.27

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）C 日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X 0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

注：本基金本报告期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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
基金合同生效日（2022 年 4 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	50,003,500.07	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	50,003,500.07	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.5027%	-%
项目	上年度可比期间 2022 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 22 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
基金合同生效日（2022 年 4 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	50,003,500.07	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	50,003,500.07	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.0569%	-%

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

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

#### 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及上年度末均未持有本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 22 日（基金合同生效日）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
浦发银行	15,763,230.71	110,897.61	23,011,859.02	464,668.90

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计 250,317,478.65 元，占基金资产净值的比例为 26.54%。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期费用 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 22 日（基金合 同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	22,058.42	-
当期持有基金产生的应支付销售 服务费（元）	4,648.26	9,670.27
当期持有基金产生的应支付管理 费（元）	569,490.24	396,057.34
当期持有基金产生的应支付托管 费（元）	136,748.71	114,933.40

#### 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
000701	厦门 信达	2023 年 6 月 28 日	6 个 月	非公开 发行流 通受限	5.19	6.09	96,339	499,999.41	586,704.51	-
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	126,422	999,998.02	1,016,432.88	-

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	5,000	500,000.00	692,550.00	-
300020	银江技术	2023年5月16日	6个月	非公开发行流通受限	7.20	8.57	69,444	499,996.80	595,135.08	-
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	28,393	1,000,001.46	840,432.80	-
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	22,714	-	672,334.40	注1
601500	通用股份	2023年3月24日	6个月	非公开发行流通受限	3.48	4.00	143,678	499,999.44	574,712.00	-
601778	晶科科技	2023年2月28日	6个月	非公开发行流通受限	4.43	4.85	225,734	1,000,001.62	1,094,809.90	-
603912	佳力图	2023年3月30日	6个月	非公开发行流通受限	10.95	9.49	45,662	499,998.90	433,332.38	-
603912	佳力图	2023年6月9日	4个月	非公开发行流通受限-转增	-	9.49	18,265	-	173,334.85	注2
603936	博敏电子	2023年4月10日	6个月	非公开发行流通受限	11.81	11.43	42,337	499,999.97	483,911.91	-

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，向全体股东按每10股转增8股。本基金新增22,714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0.1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18,265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：本基金本报告期末未持有因参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 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%，投资于单只基金市值不高于本基金资产净值的 20%。

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	0.00	-
AAA 以下	223,456.33	-

未评级	0.00	-
合计	223,456.33	-

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持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 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、买入返售金融资产及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	15,763,230.71	-	-	-	-	-	15,763,230.71
结算备付金	71,363.32	-	-	-	-	-	71,363.32
存出保证金	21,193.62	-	-	-	-	-	21,193.62
交易性金融资产	-	-48,801,336.99	223,456.33	-	-	883,338,225.28	932,363,018.60
买入返售金融资产	-1,084.93	-	-	-	-	-	-1,084.93
应收申购款	3,454.52	-	-	-	-	1,404,683.09	1,408,137.61
应收清算款	-	-	-	-	-	6,264,545.02	6,264,545.02
其他资产	-	-	-	-	-	753.99	753.99
资产总计	15,858,157.24	-48,801,336.99	223,456.33	-	-	891,008,207.38	955,891,157.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,339,885.62	12,339,885.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	176,509.49	176,509.49

应付托管费	-	-	-	-	-	74,799.49	74,799.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	81,632.15	81,632.15
应交税费	-	-	-	-	-	1,667.04	1,667.04
其他负债	-	-	-	-	-	89,333.24	89,333.24
负债总计	-	-	-	-	-	12,763,827.03	12,763,827.03
利率敏感度缺口	15,858,157.24	-48,801,336.99	223,456.33	-	-	878,244,380.35	943,127,330.91
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	31,717,579.72	-	-	-	-	-	31,717,579.72
结算备付金	184,605.48	-	-	-	-	-	184,605.48
存出保证金	37,735.22	-	-	-	-	-	37,735.22
交易性金融资产	-	-81,030,904.11	-	-	-	-1,347,938,170.56	1,428,969,074.67
买入返售金融资产	-1,494.01	-	-	-	-	-	-1,494.01
应收股利	-	-	-	-	-	158,367.20	158,367.20
应收申购款	-	-	-	-	-	393,592.12	393,592.12
应收清算款	-	-	-	-	-	4,026,617.34	4,026,617.34
其他资产	-	-	-	-	-	762.04	762.04
资产总计	31,938,426.41	-81,030,904.11	-	-	-	-1,352,517,509.26	1,465,486,839.78
负债							
应付赎回	-	-	-	-	-	19,954,111.21	19,954,111.21

回款							
应付管理人报酬						296,958.27	296,958.27
应付托管费						127,027.43	127,027.43
应付销售服务费						144,829.34	144,829.34
其他负债						146,621.74	146,621.74
负债总计						20,669,547.99	20,669,547.99
利率敏感度缺口	31,938,426.41	-81,030,904.11				-1,331,847,961.27	1,444,817,291.79

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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）
	市场利率+1%	-313,876.16	-281,851.41
	市场利率-1%	318,057.92	283,852.01

#### 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 外汇风险敞口

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。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中投资于债券型证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%。本基金投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；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	7,163,690.71	0.76	18,079,160.18	1.25
交易性金融资产—基金投资	876,174,534.57	92.90	1,329,859,010.38	92.04
交易性金融资产—债券投资	49,024,793.32	5.20	81,030,904.11	5.61
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	932,363,018.60	98.86	1,428,969,074.67	98.90

#### 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	88,584,262.81	115,139,568.99

	10%		
	业绩比较基准下降	-88,584,262.81	-115,139,568.99
	10%		

#### 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	876,397,990.90	1,329,859,010.38
第二层次	48,801,336.99	81,030,904.11
第三层次	7,163,690.71	18,079,160.18
合计	932,363,018.60	1,428,969,074.67

###### 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6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（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

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 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	7,163,690.71	0.75
	其中：股票	7,163,690.71	0.75
2	基金投资	876,174,534.57	91.66
3	固定收益投资	49,024,793.32	5.13
	其中：债券	49,024,793.32	5.13
	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	-1,084.93	-0.00
	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	15,834,594.03	1.66
8	其他各项资产	7,694,630.24	0.80
9	合计	955,891,157.94	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	-	-
C	制造业	4,887,041.22	0.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,094,809.90	0.12
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	586,704.51	0.06

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	595,135.08	0.06
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,163,690.71	0.76

### 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	300442	润泽科技	51,107	1,512,767.20	0.16
2	601778	晶科科技	225,734	1,094,809.90	0.12
3	002765	蓝黛科技	126,422	1,016,432.88	0.11
4	002865	钧达股份	5,000	692,550.00	0.07
5	603912	佳力图	63,927	606,667.23	0.06
6	300020	银江技术	69,444	595,135.08	0.06
7	000701	厦门信达	96,339	586,704.51	0.06
8	601500	通用股份	143,678	574,712.00	0.06
9	603936	博敏电子	42,337	483,911.91	0.05

### 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	601778	晶科科技	1,000,001.62	0.07
2	300442	润泽科技	1,000,001.46	0.07
3	002765	蓝黛科技	999,998.02	0.07
4	002865	钧达股份	500,000.00	0.03
5	603936	博敏电子	499,999.97	0.03

6	601500	通用股份	499,999.44	0.03
7	000701	厦门信达	499,999.41	0.03
8	603912	佳力图	499,998.90	0.03
9	300020	银江技术	499,996.80	0.03

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

#### 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	688099	晶晨股份	2,279,539.54	0.16
2	001896	豫能控股	2,210,519.44	0.15
3	002617	露笑科技	2,209,935.08	0.15
4	002624	完美世界	2,141,987.00	0.15
5	601698	中国卫通	2,120,373.86	0.15
6	000591	太阳能	2,111,361.00	0.15
7	002108	沧州明珠	1,989,900.58	0.14
8	688303	大全能源	1,930,390.63	0.13
9	002053	云南能投	1,863,331.72	0.13
10	300496	中科创达	1,106,149.44	0.08
11	688033	天宜上佳	143,864.11	0.01

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

#### 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	5,999,995.62
卖出股票收入（成交）总额	20,107,352.40

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	8,042,104.11	0.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,759,232.88	4.32
	其中：政策性金融债	40,759,232.88	4.32
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）	223,456.33	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	49,024,793.32	5.20
----	----	---------------	------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	190305	19 进出 05	400,000	40,759,232.88	4.32
2	019703	23 国债 10	80,000	8,042,104.11	0.85
3	110081	闻泰转债	2,000	223,456.33	0.02

## 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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.10.2 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。

## 7.11 本报告期投资基金情况

### 7.11.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。本基金主要投资于公开募集证券投资基金，其中投资于债券型证券投资基金的比例不低于本基金资产的 80%，投资于港股通标的股票占股票资产的 0-50%；本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金整体风险等级为 R2，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

### 7.11.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管
----	------	------	------	---------	---------	------------------	--------------------

							理的基金
1	006985	兴全恒裕债券 A	契约型开放式	88,007,364.20	96,376,864.54	10.22	是
2	012324	兴证全球恒惠 30 天持有超短债 A	契约型开放式	81,296,007.02	87,214,356.33	9.25	是
3	040026	华安信用四季红债券 A	契约型开放式	49,162,179.48	51,639,953.33	5.48	否
4	000032	易方达信用债券 A	契约型开放式	36,677,256.89	41,217,901.29	4.37	否
5	004388	鹏华丰享债券	契约型开放式	33,423,222.33	39,185,385.86	4.15	否
6	003327	万家鑫璟纯债债券 A	契约型开放式	27,737,991.89	33,746,040.93	3.58	否
7	100058	富国产业债债券 A	契约型开放式	25,776,465.36	30,717,813.77	3.26	否
8	006870	广发景和中短债债券 A	契约型开放式	26,606,163.29	27,444,257.43	2.91	否
9	014086	兴证全球恒悦 180 天持有债券 A	契约型开放式	23,612,956.49	25,216,276.24	2.67	是
10	003863	招商招祥纯债 A	契约型开放式	22,221,759.59	24,095,053.92	2.55	否
11	003859	招商招旭纯债 A	契约型开放式	17,037,118.82	22,412,329.81	2.38	否
12	009306	平安惠铭纯债债券	契约型开	20,585,906.26	22,374,821.51	2.37	否

			放式				
13	000186	华泰柏瑞季季红债券	契约型开放式	19,916,028.09	21,471,469.88	2.28	否
14	161820	银华纯债信用债券(LOF)	上市契约型开放式(LOF)	17,624,910.39	19,775,149.46	2.10	否
15	002650	东方红稳添利纯债债券 A	契约型开放式	16,772,040.67	18,353,644.11	1.95	否
16	007616	富国投资级信用债债券 A	契约型开放式	15,770,672.43	16,256,409.14	1.72	否
17	004614	鹏扬利泽债券 A	契约型开放式	15,434,584.17	16,252,617.13	1.72	否
18	003265	招商招坤纯债债券 A	契约型开放式	11,890,646.35	15,162,952.23	1.61	否
19	006874	创金合信恒兴中短债债券 A	契约型开放式	12,063,174.95	14,457,715.18	1.53	否
20	008030	农银金益债券	契约型开放式	14,004,002.44	14,358,303.70	1.52	否
21	005709	华安鼎益债券 A	契约型开放式	12,269,359.69	13,329,432.37	1.41	否
22	004027	广发景源纯债 A	契约型开放式	11,665,309.06	12,375,726.38	1.31	否
23	340009	兴全磐稳增利债券 A	契约型开放式	7,656,634.68	12,300,383.61	1.30	是

24	005623	广发中债 1-3 年农发债指数 A	契约型开放式	8,634,288.25	9,197,243.84	0.98	否
25	008482	广发央企 80 债券指数 A	契约型开放式	8,648,747.83	9,183,240.45	0.97	否
26	009670	东方红益丰纯债债券	契约型开放式	7,703,208.74	8,295,585.49	0.88	否
27	001235	中银国有企业债 A	契约型开放式	6,695,599.36	7,462,915.05	0.79	否
28	000205	易方达投资级信用债债券 A	契约型开放式	6,361,060.17	7,366,107.68	0.78	否
29	004127	鹏华丰康债券	契约型开放式	5,866,371.68	6,445,969.20	0.68	否
30	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	5,620,095.81	6,363,634.49	0.67	是
31	006513	鹏扬淳享债券 A	契约型开放式	6,102,351.17	6,282,370.53	0.67	否
32	012325	兴证全球恒惠 30 天持有超短债 C	契约型开放式	5,724,281.70	6,121,546.85	0.65	是
33	010673	兴全中证 800 六个月持有指数 A	契约型开放式	6,202,455.80	6,030,647.77	0.64	是
34	450009	国富中小盘股票	契约型开放式	2,325,513.52	5,817,969.72	0.62	否
35	010393	工银健康生活混合 A	契约型开放式	7,623,669.37	5,776,454.28	0.61	否

36	008245	圆信永丰致优混合 A	契约型开放式	2,851,228.29	5,714,716.86	0.61	否
37	007321	鹏华金利债券	契约型开放式	5,065,290.04	5,335,776.53	0.57	否
38	006337	华安安浦债券 A	契约型开放式	4,681,588.31	5,114,167.07	0.54	否
39	006624	中泰玉衡价值优选混合	契约型开放式	2,334,799.19	4,965,884.40	0.53	否
40	002659	兴业中债 1-3 年政策性金融债 A	契约型开放式	4,420,153.90	4,815,315.66	0.51	否
41	513500	博时标普 500ETF(QDII)	交易型开放式 (ETF)	2,984,100.00	4,485,102.30	0.48	否
42	005421	中欧嘉泽灵活配置混合	契约型开放式	2,027,329.51	4,121,763.63	0.44	否
43	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	1,061,244.73	4,029,546.24	0.43	否
44	110053	易方达安源中短债债券 A	契约型开放式	3,545,722.38	3,865,191.97	0.41	否
45	006662	易方达安悦超短债债券 A	契约型开放式	3,607,856.97	3,674,602.32	0.39	否
46	519915	富国消费主题混合 A	契约型开放式	1,416,815.35	3,612,879.14	0.38	否
47	159920	恒生 ETF	交易型开	3,100,800.00	3,463,593.60	0.37	否

			放式 (ETF)				
48	161911	万家强债	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,471,856.00	3,433,665.58	0.36	否
49	007802	兴全合泰混合 A	契约 型开 放式	2,439,095.70	3,392,050.39	0.36	是
50	166001	中欧新趋势混 合(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,872,214.64	3,332,917.87	0.35	否
51	163417	兴全合宜	上市 契约 型开 放式 (LOF)	2,298,771.00	3,278,047.45	0.35	是
52	184801	鹏华前海	上市 契约 型开 放式 (LOF)	33,500.00	3,193,823.00	0.34	否
53	007549	中泰开阳价值 优选混合 A	契约 型开 放式	1,600,201.27	3,162,317.75	0.34	否
54	000471	富国城镇发展 股票	契约 型开 放式	1,320,597.75	3,009,642.27	0.32	否
55	166019	中欧价值智选 混合 A	契约 型开 放式	714,455.38	2,935,197.04	0.31	否
56	518880	华安黄金易 (ETF)	交易 型开 放式	664,400.00	2,889,475.60	0.31	否

			(ETF)				
57	007880	朱雀产业智选混合 A	契约型开放式	2,073,440.22	2,798,107.58	0.30	否
58	159934	黄金 ETF	交易型开放式 (ETF)	626,900.00	2,699,431.40	0.29	否
59	163415	兴全商业模式优选混合 (LOF)	上市契约型开放式 (LOF)	755,623.04	2,503,379.13	0.27	是
60	003501	泰达睿智稳健混合	契约型开放式	2,206,884.38	2,433,310.72	0.26	否
61	002301	兴业短债债券 A	契约型开放式	2,195,351.23	2,259,455.49	0.24	否
62	513100	国泰纳斯达克 100(QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	2,042,900.00	2,247,190.00	0.24	否
63	159915	创业板	交易型开放式 (ETF)	974,700.00	2,109,250.80	0.22	否
64	002980	华夏创新前沿股票	契约型开放式	840,522.51	2,058,439.63	0.22	否
65	010792	华安成长先锋混合 A	契约型开放式	1,879,936.81	1,938,778.83	0.21	否
66	169106	东证创优	上市契约型开	1,882,421.00	1,914,422.16	0.20	否

			放式 (LOF)				
67	011649	易方达逆向投资混合 A	契约 型开 放式	1,748,590.98	1,788,983.43	0.19	否
68	487021	工银优质精选混合	契约 型开 放式	580,018.53	1,747,595.83	0.19	否
69	161121	易方达中证银行指数(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,207,797.95	1,295,363.30	0.14	否
70	160325	华夏创业	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,258,100.00	1,099,579.40	0.12	否
71	506000	南方科创板 3 年定开混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	1,444,700.00	1,084,969.70	0.12	否
72	515180	易方达中证红利 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	835,200.00	1,075,737.60	0.11	否
73	163417	兴全合宜混合(LOF)A	上市 契约 型开 放式 (LOF)	731,500.00	1,052,116.45	0.11	是
74	506005	博时科创板三年定开混合	上市 契约 型开 放式 (LOF)	772,600.00	625,806.00	0.07	否

75	501054	东方红睿泽三年定开混合 A	上市契约型开放式 (LOF)	496,900.00	509,322.50	0.05	否
76	163415	兴全模式	上市契约型开放式 (LOF)	141,400.00	468,175.40	0.05	是
77	501202	华泰紫金科创 3 年封闭混合 C	契约型开放式	321,376.00	313,341.60	0.03	否
78	506008	长城科创两年定开混合 A	上市契约型开放式 (LOF)	196,000.00	158,956.00	0.02	否
79	161014	富国汇利	上市契约型开放式 (LOF)	69,274.00	88,601.45	0.01	否

## 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	21,193.62
2	应收清算款	6,264,545.02
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	1,408,137.61
6	其他应收款	753.99
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,694,630.24

#### 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	110081	闻泰转债	223,456.33	0.02

#### 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	300442	润泽科技	1,512,767.20	0.16	非公开发行流通受限
2	601778	晶科科技	1,094,809.90	0.12	非公开发行流通受限
3	002765	蓝黛科技	1,016,432.88	0.11	非公开发行流通受限
4	002865	钧达股份	692,550.00	0.07	非公开发行流通受限
5	603912	佳力图	606,667.23	0.06	非公开发行流通受限
6	300020	银江技术	595,135.08	0.06	非公开发行流通受限
7	000701	厦门信达	586,704.51	0.06	非公开发行流通受限
8	601500	通用股份	574,712.00	0.06	非公开发行流通受限
9	603936	博敏电子	483,911.91	0.05	非公开发行流通受限

#### 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（%）
兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	14,408	37,315.76	75,326,212.03	14.01	462,319,300.77	85.99
兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C	28,247	13,136.41	5,166,217.03	1.39	365,897,942.98	98.61
合计	42,655	21,303.71	80,492,429.06	8.86	828,217,243.75	91.14

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	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	340,624.26	0.0634
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C	253,429.13	0.0683
	合计	594,053.39	0.0654

## 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	0~10
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	0~10
	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C	0
	合计	0~10

注：本基金的基金经理也是本公司高级管理人员及基金研究部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A	兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 22 日) 基金份额总额	1,400,964,216.65	1,002,277,017.19
本报告期期初基金 份额总额	795,074,332.68	629,614,942.20
本报告期基金总申 购份额	60,500,918.64	21,338,639.19
减：本报告期基金 总赎回份额	317,929,738.52	279,889,421.38
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	537,645,512.80	371,064,160.01

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

## 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7.2 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。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	3	13,633,184.26	67.80	8,606.62	67.80	-
华泰证券	2	6,474,168.14	32.20	4,087.25	32.20	-
申万宏源证券	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。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
兴业	-	-	-	-	-	-	21,680,128.48	38.25

证 券								
华 泰 证 券	14,600,481.47	100.00	15,000,000.00	100.00	-	-	35,000,854.52	61.75
申 万 宏 源 证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金经理变更公告	证券时报、规定互联网网站	2023年1月4日
2	兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）（兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF A 类份额）基金产品资料概要更新	证券时报、规定互联网网站	2023年1月9日
3	兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）（兴证全球优选稳健六个月持有债券 FOF C 类份额）基金产品资料概要更新	证券时报、规定互联网网站	2023年1月9日
4	兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）更新招募说明书（20230109 更新）	证券时报、规定互联网网站	2023年1月9日
5	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	证券时报、规定互联网网站	2023年2月16日
6	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	证券时报、规定互联网网站	2023年2月21日
7	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	证券时报、规定互联网网站	2023年2月28日
8	关于旗下部分基金投资晶科科技（601778）非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2023年3月2日
9	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	证券时报、规定互联网网站	2023年3月23日
10	关于旗下部分基金投资通用股份（601500）非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2023年3月28日
11	关于旗下部分基金投资佳力图（603912）非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2023年4月1日

12	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	证券时报、规定互联网网站	2023 年 4 月 12 日
13	关于增加上海农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2023 年 5 月 15 日
14	关于旗下部分基金投资银江技术（300020）非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2023 年 5 月 18 日
15	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	证券时报、规定互联网网站	2023 年 6 月 14 日
16	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	证券时报、规定互联网网站	2023 年 6 月 20 日
17	关于旗下部分基金投资厦门信达（000701）非公开发行股票的公告	证券时报、规定互联网网站	2023 年 6 月 30 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

1、本基金每份基金份额的最短持有期限为 6 个月。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起 6 个月后的月度对日（即最短持有期到期日）。若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。本基金每份基金份额自其最短持有期到期日（含该日）起，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）注册的批复文件
- 2、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）基金合同》
- 3、《兴证全球优选稳健六个月持有期债券型基金中基金（FOF）托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会规定的其它文件

### 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