

# 兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：兴全基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>60</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	65

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	65
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	65
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.4 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的情况 .....	67
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>69</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>70</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>76</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	兴全合宜混合
场内简称	兴全合宜
基金主代码	163417
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 23 日
基金管理人	兴全基金管理有限公司
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	32,699,590,743.51 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2018 年 4 月 23 日

注：本基金的封闭期自 2018 年 1 月 23 日起至 2020 年 1 月 22 日止，自 2020 年 1 月 23 日起本基金转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

### 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	本基金为灵活配置混合型基金，投资策略细分为资产配置策略、股票投资策略，以及股指期货、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率× 60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，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。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

### 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		兴全基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084

	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路368号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼28-30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		兰荣	李建红

注：2020年3月18日，基金管理人名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

## 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xqfunds.com">http://www.xqfunds.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路222号30楼
注册登记机构	A类份额：中国证券登记结算有限责任公司 C类份额：兴全基金管理有限公司	A类份额：北京市西城区太平桥大街17号 C类份额：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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年 1 月 23 日 (基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	2017 年
本期已实现收益	2,553,266,152.19	-1,690,422,842.93	-
本期利润	10,038,807,947.50	-5,479,594,965.07	-
加权平均基金份额本期利润	0.3070	-0.1676	-
本期加权平均净值利润率	29.85%	-18.18%	-
本期基金份额净值增长率	36.88%	-16.76%	-
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	862,843,378.14	-5,479,594,922.54	-
期末可供分配基金份额利润	0.0264	-0.1676	-
期末基金资产净值	37,258,803,725.02	27,219,997,040.26	-
期末基金份额净值	1.1394	0.8324	-
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	13.94%	-16.76%	-

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.66%	0.55%	6.24%	0.57%	-1.58%	-0.02%
过去六个月	7.97%	0.68%	4.39%	0.64%	3.58%	0.04%
过去一年	36.88%	0.98%	23.21%	0.88%	13.67%	0.10%
自基金合同生效起至今	13.94%	0.93%	-3.72%	0.95%	17.66%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准为： $\times$ 沪深 300 指数 $\times$ 60%+恒生指数收益率 $\times$ 20% +中国债券总指数收益率 $\times$ 20%，在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：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。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。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司于 2001 年 12 月 31 日推出的债券指数。它是中国债券市场趋势的表征，也是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。中国债券总指数为掌握我国债券市场价格总水平、波动幅度和变动趋势，测算债券投资回报率水平，判断债券供求动向提供了很好的依据。

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：

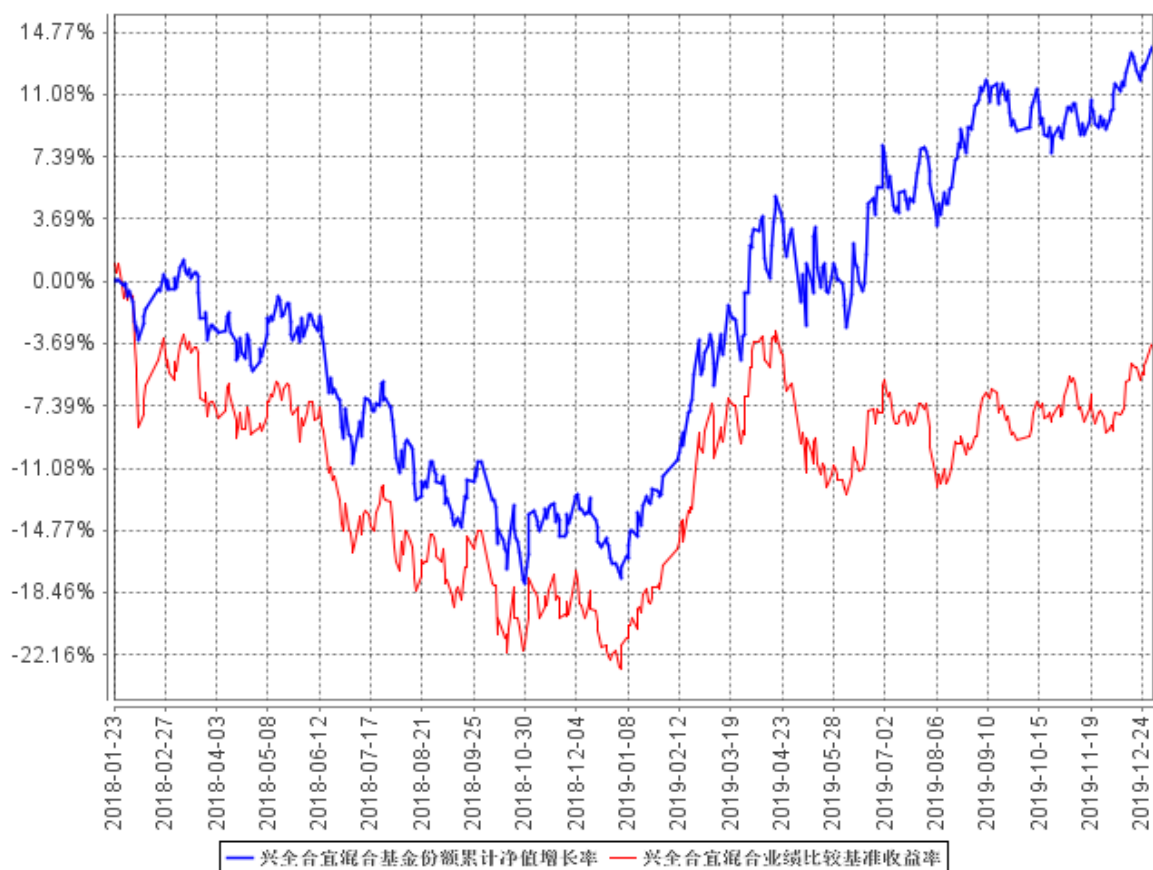
$$\text{Return } t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率 } t / \text{恒生指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{中国债券总指数收益率 } t / \text{中国债券总指数收益率 } t-1 - 1)$$
$$\text{Benchmark } t = (1 + \text{Return } t) \times (1 + \text{Benchmark } t-1) - 1$$

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

兴全合宜混合基金份额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

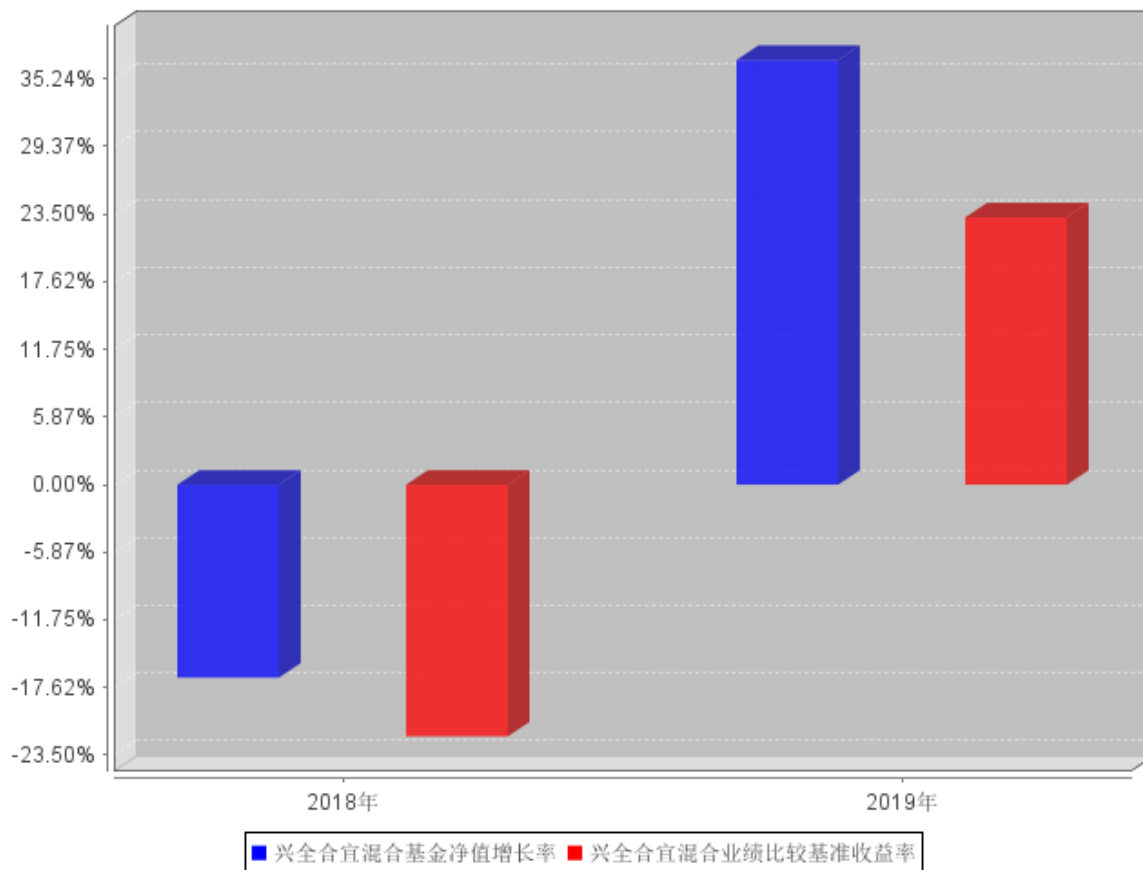


注：1、净值表现所取数据截至到 2019 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2018 年 1 月 23 日至 2018 年 7 月 22 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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

兴全合宜混合自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2018 年数据统计期间为 2018 年 1 月 23 日（基金合同生效之日）至 2018 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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

兴全基金管理有限公司（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”。

截至2019年12月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金及兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金共28只基金。

#### 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		
谢治宇	基金管理部投资总	2018年1月23日	-	12年	经济学硕士，2007年加入兴全基金管理有限

	监兼本基金、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理			公司，历任行业研究员、专户投资部任投资经理、基金管理部投资副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（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、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

## 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、《兴全合宜灵活配置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 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 A 股市场表现活跃，同时行业间分化明显。全年上证指数上涨 22.3%，创业板指上涨 43%。一季度在信用释放加速，风险偏好修复的环境下指数普涨，二季度受中美贸易摩擦的影响有所回落，三四季度指数震荡，电子、建材等高景气的行业表现较好。去杠杆政策的缓和，使得 2019 年市场整体估值有所提升，中美贸易摩擦的变化，对市场的风险偏好产生了阶段性的影响。部分行业随着行业景气度回升，股价也有良好的表现。全年来看，电子、食品饮料、家电行业在 2019 年表现较好，而建筑装饰、钢铁、公用事业行业则表现偏弱。

本基金年初提升了股票仓位，四季度则降低仓位为流动性做一定的准备，整体持仓结构变化不大。整体配置以具备中长期逻辑支撑、估值合适的中长期价值品种为主，在控制风险的前提下适当增加了阶段性受益于行业边际改善的品种，总体结构均衡。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1394 元；本报告期基金份额净值增长率为 36.88%，业绩比较基准收益率为 23.21%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年银行间的流动性持续偏松，并逐步向实体传导。随着经济托底政策的逐步出台，2019 年宏观经济整体显示出较强的韧性，在四季度也出现一些积极的信号。2019 年末新冠肺炎疫情的爆发，使得经济短期的不确定性增加，部分行业会受到较大的挑战，但短期冲击并不改变经济中长期的趋势，也并不影响很多产业的长期前景和企业的长期价值。

在相对宽松的流动性环境下，2019 年权益市场的活跃度明显提升。2019 年底，以沪深 300 为代表的 A 股的整体估值仍然处于历史较低的水平，部分反映了对于盈利增速下行的预期，从全球的相对估值，以及与无风险利率的对比来看，权益市场仍然具有不错的性价比，海外资金的持续流入，也反映了对部分优质企业的认可。预计流动性环境将维持偏宽松的格局，市场仍然有结构性行情的机会。

本基金整体操作仍然本着风险控制的原则，坚定持有以基本面中长期逻辑为基础的品种，均衡配置，降低波动，以期更好地为投资者创造长期价值。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

- 1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基

础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《基金法》、《兴全合宜灵活配置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，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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



## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(20)第 P00667 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>兴全基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴全合宜灵活配置混合型证</p>

	<p>券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	汪芳	侯雯
会计师事务所的地址	上海市延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2020 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,630,018,191.00	1,355,572,393.38
结算备付金		45,754,258.75	5,480,003.98
存出保证金		13,833,140.78	2,329,768.08
交易性金融资产	7.4.7.2	21,839,146,602.05	25,811,890,833.70
其中：股票投资		20,197,096,602.05	13,289,714,253.32
基金投资		-	-
债券投资		1,642,050,000.00	12,522,176,580.38
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	12,599,500,000.00	-
应收证券清算款		174,980,548.92	299,023,002.36
应收利息	7.4.7.5	17,677,756.09	190,641,427.99
应收股利		2,590,996.79	1,163,403.97
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	75,156.17
资产总计		37,323,501,494.38	27,666,175,989.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	400,200,000.00
应付证券清算款		-	1,115,301.70
应付赎回款		8.60	2.53
应付管理人报酬		46,640,565.72	35,617,497.50
应付托管费		7,773,427.62	5,936,249.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,875,182.30	2,518,950.99
应交税费		188,585.12	580,947.08
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	220,000.00	210,000.00
负债合计		64,697,769.36	446,178,949.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	32,699,590,743.51	32,699,591,962.80
未分配利润	7.4.7.10	4,559,212,981.51	-5,479,594,922.54
所有者权益合计		37,258,803,725.02	27,219,997,040.26
负债和所有者权益总计		37,323,501,494.38	27,666,175,989.63

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1394 元，基金份额总额 32,699,590,743.51 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 23 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		10,691,770,076.04	-4,933,056,059.58
1. 利息收入		274,429,274.39	522,261,932.18
其中：存款利息收入	7.4.7.11	16,553,520.94	116,799,560.83
债券利息收入		248,240,546.83	356,281,259.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,635,206.62	49,181,111.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,931,799,006.20	-1,666,197,722.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,150,111,994.32	-1,991,984,380.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	334,535,224.01	67,836,443.59
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	447,151,787.87	257,950,214.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,485,541,795.31	-3,789,172,122.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	0.14	51,852.65
<b>减：二、费用</b>		652,962,128.54	546,538,905.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	503,575,937.46	423,829,393.52

2. 托管费	7.4.10.2.2	83,929,322.86	70,638,232.29
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	63,673,801.26	49,048,162.96
5. 利息支出		1,033,338.34	2,071,529.19
其中：卖出回购金融资产支出		1,033,338.34	2,071,529.19
6. 税金及附加		374,555.01	506,793.91
7. 其他费用	7.4.7.20	375,173.61	444,793.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,038,807,947.50	-5,479,594,965.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,038,807,947.50	-5,479,594,965.07

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,699,591,962.80	-5,479,594,922.54	27,219,997,040.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,038,807,947.50	10,038,807,947.50
三、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）	-1,219.29	-43.45	-1,262.74
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-1,219.29	-43.45	-1,262.74
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,699,590,743.51	4,559,212,981.51	37,258,803,725.02
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	32,699,592,445.33	-	32,699,592,445.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,479,594,965.07	-5,479,594,965.07
三、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）	-482.53	42.53	-440.00
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-482.53	42.53	-440.00
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	32,699,591,962.80	-5,479,594,922.54	27,219,997,040.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          兰荣          </u>	<u>          庄园芳          </u>	<u>          詹鸿飞          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人兴全基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）以证监许可[2017]2233号文核准予以公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集基金份额为 32,699,592,445.33 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(18)第 00050 号验资报告。基金合同于 2018 年 1 月 23 日正式生效。本基金的管理人为兴全基金管理有限公司，托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、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、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、权证、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。

基金的投资组合比例为：本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%—95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%），封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%—100%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%—50%）；权证投资比例为基金资产净值的 0%—3%；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率× 60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。



#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资。

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法确认债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (3) 回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍

认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同

利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提。

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出成交日确认，并按卖出成交金额与其成本的差额入账。

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提。

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提。

(3) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.60%年费率逐日计提。

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 封闭期间，基金收益分配采用现金方式；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，登记在登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，其基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资人可选择获取现金红利或将现金红利按再投日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在深圳证券账户的基金份额只能采取现金分红方式，不能选择红利再投资；具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，在收益分配数额方面可能有所不同。本基金同一类别内

的每份基金份额享有同等分配权；

(3) 若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(4) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

(2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及

银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)

的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
活期存款	2,630,018,191.00	1,355,572,393.38
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	2,630,018,191.00	1,355,572,393.38

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	16,502,737,579.70	20,197,096,602.05	3,694,359,022.35	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	1,640,039,349.18	1,642,050,000.00	2,010,650.82
	合计	1,640,039,349.18	1,642,050,000.00	2,010,650.82

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	18,142,776,928.88	21,839,146,602.05	3,696,369,673.17
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	17,154,909,768.63	13,289,714,253.32	-3,865,195,515.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,874,671,568.56	2,847,231,580.38
	银行间市场	9,571,481,618.65	9,674,945,000.00
	合计	12,446,153,187.21	12,522,176,580.38
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	29,601,062,955.84	25,811,890,833.70	-3,789,172,122.14

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	12,599,500,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	12,599,500,000.00	-
项目	上年度末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未通过买断式逆回购交易取得债券。



## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	1,150,313.85	334,308.66
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	9,926.80	2,712.60
应收债券利息	9,025,647.88	190,303,253.88
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	7,487,970.33	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3,897.23	1,152.85
合计	17,677,756.09	190,641,427.99

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
其他应收款	-	75,156.17
待摊费用	-	-
合计	-	75,156.17

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	9,833,482.30	2,505,450.99
银行间市场应付交易费用	41,700.00	13,500.00
合计	9,875,182.30	2,518,950.99

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	210,000.00
合计	220,000.00	210,000.00

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,699,591,962.80	32,699,591,962.80
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-1,219.29	-1,219.29
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	32,699,590,743.51	32,699,590,743.51

注：本期赎回含低于最低持有份额而强制赎回的份额。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,690,422,831.53	-3,789,172,091.01	-5,479,594,922.54
本期利润	2,553,266,152.19	7,485,541,795.31	10,038,807,947.50
本期基金份额交易产生的变动数	57.48	-100.93	-43.45
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	57.48	-100.93	-43.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	862,843,378.14	3,696,369,603.37	4,559,212,981.51

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日) 至2018年12月31日
	活期存款利息收入	16,028,381.52

定期存款利息收入	-	97,374,611.09
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	425,881.13	1,572,344.56
其他	99,258.29	121,112.17
合计	16,553,520.94	116,799,560.83

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金 合同生效日)至2018年12月 31日
卖出股票成交总额	24,447,359,107.19	11,467,888,127.18
减：卖出股票成本总额	22,297,247,112.87	13,459,872,507.20
买卖股票差价收入	2,150,111,994.32	-1,991,984,380.02

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日
债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入	334,535,224.01	67,836,443.59
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	334,535,224.01	67,836,443.59

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	25,631,825,494.71	14,965,148,570.01
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	24,928,910,480.78	14,726,496,464.51
减：应收利息总额	368,379,789.92	170,815,661.91
买卖债券差价收入	334,535,224.01	67,836,443.59

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未投资衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	447,151,787.87	257,950,214.16
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	447,151,787.87	257,950,214.16

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	7,485,541,795.31	-3,789,172,122.14
——股票投资	7,559,554,537.66	-3,865,195,515.31
——债券投资	-74,012,742.35	76,023,393.17
——资产支持证券投资	-	-
——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	7,485,541,795.31	-3,789,172,122.14

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	0.14	0.22
其他	-	51,852.43
合计	0.14	51,852.65

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	63,557,601.26	48,939,225.61
银行间市场交易费用	116,200.00	108,937.35
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	63,673,801.26	49,048,162.96

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	100,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费用	37,200.00	23,200.00
上市费	60,000.00	135,000.00
银行费用	57,973.61	76,193.62
证券开户费	-	400.00
合计	375,173.61	444,793.62

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，基金合同生效后，封闭期为两年(含两年)，自基金合同生效之日起至两年后对应日前一个工作日止，封闭期届满后转换为上市开放式基金（LOF）。本基金的封闭期自自 2018 年 1 月 23 日起至 2020 年 1 月 22 日止，自 2020 年 1 月 23 日起转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，基金简称、基金场内简称与基金代码不变。

本基金的基金管理人于 2020 年 3 月 18 日由“兴全基金管理有限公司”更名为“兴证全球基金管理有限公司”。

除以上情况外，本基金无其他需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴全基金管理有限公司（以下简称“兴全基金”）	基金管理人，基金销售机构
招商银行股份有限公司（以下简称“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（以下简称“兴业证券”）	基金管理人的股东，基金销售机构
全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）	基金管理人的股东
上海兴全睿众资产管理有限公司	基金管理人控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
兴业证券	9,216,030,286.43	20.18%	7,425,625,867.51	17.84%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年 12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例
兴业证券	2,480,566,582.08	34.55%	2,075,516,553.68	74.81%

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年 12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
兴业证券	5,500,000,000.00	16.22%	27,408,000,000.00	23.45%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
兴业证券	8,654,274.59	26.20%	3,222,374.34	32.77%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
兴业证券	6,977,506.29	23.20%	730,506.32	29.16%

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

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	503,575,937.46	423,829,393.52
其中：支付销售机构的客户维护费	183,660,042.42	157,821,944.21

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。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	83,929,322.86	70,638,232.29

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。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期			
2019年1月1日至2019年12月31日			
银行间市场交	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购



易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	10,189,846.85	-	-	-	-	-

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

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2018 年 1 月 23 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	37,067,337.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	37,067,337.00
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	37,067,337.00	37,067,337.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.1134%	0.1134%

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

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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	50,000.00	0.0002%	-	-

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月23日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	2,630,018,191.00	16,028,381.52	1,355,572,393.38	17,731,493.01

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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	
688199	久日	2019年10	2020年5	新股流通	66.68	59.66	4,494	299,659.92	268,112.04	-	

	新材	月 28 日	月 6 日	受限							
688188	柏楚电子	2019 年 7 月 31 日	2020 年 2 月 10 日	新股流通受限	68.58	152.09	7,847	538,147.26	1,193,450.23	-	
688058	宝兰德	2019 年 10 月 25 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	79.30	90.65	1,450	114,985.00	131,442.50	-	
688025	杰普特	2019 年 10 月 24 日	2020 年 5 月 6 日	新股流通受限	43.86	38.36	4,655	204,168.30	178,565.80	-	
688001	华兴源创	2019 年 7 月 1 日	2020 年 1 月 22 日	新股流通受限	24.26	41.57	21,494	521,444.44	893,505.58	-	
603899	晨光文具	2019 年 9 月 18 日	2020 年 3 月 18 日	大宗交易购入流通受限	39.20	47.14	6,450,000	252,840,000.00	304,053,000.00	-	
603589	口子窖	2019 年 9 月 2 日	2020 年 3 月 2 日	大宗交易购入流通受限	62.99	53.44	800,000	50,392,000.00	42,752,000.00	-	
603025	大豪科技	2019 年 9 月 19 日	2020 年 3 月 19 日	大宗交易购入流通受限	8.13	9.09	9,210,000	74,877,300.00	83,718,900.00	-	
601658	邮储银行	2019 年 12 月 2 日	2020 年 6 月 10 日	新股流通受限	5.50	5.71	398,289	2,190,589.50	2,274,230.19	-	
601077	渝农商行	2019 年 10 月 16 日	2020 年 4 月 29 日	新股流通受限	7.36	6.26	147,778	1,087,646.08	925,090.28	-	
300633	开立医	2019 年 9 月 10 日	2020 年 3 月 10 日	大宗交易购入	25.36	23.15	1,000,000	25,360,000.00	23,150,000.00	-	

	疗		日	流通受限						
300633	开立医疗	2019年9月20日	2020年3月20日	大宗交易购入流通受限	25.00	22.98	2,000,000	50,000,000.00	45,960,000.00	-
300413	芒果超媒	2019年7月29日	2020年2月3日	大宗交易购入流通受限	35.12	34.13	1,000,000	35,120,000.00	34,130,000.00	-
300413	芒果超媒	2019年10月8日	2020年2月3日	大宗交易购入流通受限-转增	-	34.13	700,000	-	23,891,000.00	注1
300413	芒果超媒	2019年8月12日	2020年2月12日	大宗交易购入流通受限	34.51	33.93	2,723,791	93,998,027.41	92,418,228.63	-
300413	芒果超媒	2019年10月8日	2020年2月12日	大宗交易购入流通受限-转增	-	33.93	1,906,654	-	64,692,770.22	注1
300413	芒果超媒	2019年9月4日	2020年3月4日	大宗交易购入流通受限	42.90	33.61	4,413,425	189,335,932.50	148,335,214.25	-
300413	芒果超媒	2019年10月8日	2020年3月4日	大宗交易购入流通受限-转增	-	33.61	3,089,398	-	103,834,666.78	注1
300413	芒	2019	2020	大宗	25.00	33.37	6,398,521	159,963,025.00	213,518,645.77	-

	果超媒	2019年10月24日	2020年4月24日	交易购入流通受限							
300413	芒果超媒	2019年11月6日	2020年5月6日	大宗交易购入流通受限	24.34	33.20	532,665	12,965,066.10	17,684,478.00	-	
300124	汇川技术	2019年9月19日	2020年3月19日	大宗交易购入流通受限	22.82	29.73	6,967,500	158,998,350.00	207,143,775.00	-	
300124	汇川技术	2019年9月20日	2020年3月20日	大宗交易购入流通受限	22.82	29.73	3,000,000	68,460,000.00	89,190,000.00	-	
003816	中国广核	2019年8月14日	2020年2月27日	新股流通受限	2.49	3.53	562,958	1,401,765.42	1,987,241.74	-	
002352	顺丰控股	2019年9月2日	2020年3月2日	大宗交易购入流通受限	38.00	36.39	5,250,000	199,500,000.00	191,047,500.00	-	
002120	韵达股份	2018年4月20日	2020年4月23日	非公开发行流通受限	39.75	31.90	5,031,446	199,999,978.50	160,503,127.40	-	
002120	韵达股份	2018年8月16日	2020年4月23日	非公开发行流通受限-转增	-	31.90	1,509,434	-	48,150,944.60	注2	
002120	韵达股份	2019年6月12日	2020年4月23日	非公开发行流通受限-	-	31.90	1,962,264	-	62,596,221.60	注2	

				转增						
000938	紫光股份	2019年9月12日	2020年3月12日	大宗交易购入流通受限	32.11	30.42	12,000,000	385,320,000.00	365,040,000.00	-
000938	紫光股份	2019年11月28日	2020年5月28日	大宗交易购入流通受限	25.49	29.72	732,288	18,666,021.12	21,763,599.36	-
000938	紫光股份	2019年12月6日	2020年6月8日	大宗交易购入流通受限	26.37	29.67	210,000	5,537,700.00	6,230,700.00	-
000938	紫光股份	2019年12月10日	2020年6月10日	大宗交易购入流通受限	26.73	29.57	3,520,000	94,089,600.00	104,086,400.00	-
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
002973	侨银环保	2019年12月27日	2020年1月6日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

注 1：本基金持有的大宗交易购入股票芒果超媒，于 2019 年 10 月 8 日实施 2019 年半年度权益分配方案，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 7 股。本基金新增 5,696,052.00 股。

注 2：本基金持有的非公开发行股票韵达股份，于 2018 年 8 月 16 日实施 2017 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 2.38 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股。本基金新增 1,509,434.00 股。

本基金持有的非公开发行股票韵达股份，于 2019 年 6 月 12 日实施 2018 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 4.76 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 3 股。本基金新增 1,962,264.00 股。

注 3：上述流通受限证券可流通日期基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告

为准。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

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

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券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。

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
A-1	-	100,970,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	250,640,000.00	-
合计	250,640,000.00	100,970,000.00

注：未评级债券为超短期融资券等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	-	3,385,413,544.00
AAA 以下	-	2,320,215,036.38
未评级	-	-
合计	-	5,705,628,580.38

注：此处的信用证券不包括国债、央票与政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	1,391,410,000.00	5,895,968,000.00
AAA 以下	-	96,580,000.00
未评级	-	-
合计	1,391,410,000.00	5,992,548,000.00

注：此处为主体信用评级。



### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另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。

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人员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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金合同生效后两年之内（含两年）为封闭期，在此期间投资者不能申购、赎回基金份额。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。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，单一投资者持有基金份额比例未超过基金总份额 50%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	2,630,018,191.00	-	-	-	-	-	-2,630,018,191.00
结算备付金	45,754,258.75	-	-	-	-	-	-45,754,258.75
存出保证金	13,833,140.78	-	-	-	-	-	-13,833,140.78

交易性金融资产	1,642,050,000.00	-	-	-	-	-20,197,096,602.05	21,839,146,602.05
买入返售金融资产	12,599,500,000.00	-	-	-	-	-	-12,599,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-174,980,548.92	174,980,548.92
应收利息	-	-	-	-	-	-17,677,756.09	17,677,756.09
应收股利	-	-	-	-	-	-2,590,996.79	2,590,996.79
资产总计	16,931,155,590.53	-	-	-	-	-20,392,345,903.85	37,323,501,494.38
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	8.60	8.60
应付管理	-	-	-	-	-	-46,640,565.72	46,640,565.72

人 报 酬							
应付 托 管 费	-	-	-	-	-	7,773,427.62	7,773,427.62
应付 交 易 费 用	-	-	-	-	-	9,875,182.30	9,875,182.30
应 交 税 费	-	-	-	-	-	188,585.12	188,585.12
其 他 负 债	-	-	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负 债 总 计	-	-	-	-	-	64,697,769.36	64,697,769.36
利 率 敏 感 度 缺 口	16,931,155.590.53	-	-	-	-	20,327,648.134.49	37,258,803.725.02
上 年 度 末 20 18 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	1,355,572,393.38	-	-	-	-	-	1,355,572,393.38
结算备付金	5,480,003.98	-	-	-	-	-	5,480,003.98
存出保证金	2,329,768.08	-	-	-	-	-	2,329,768.08
交易性金融资产	241,729,000.00	536,816,600.00	6,762,704,693.90	3,825,309,014.80	1,155,617,271.68	13,289,714,253.32	25,811,890,833.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-299,023,002.36	299,023,002.36
应收利息	-	-	-	-	-	-190,641,427.99	190,641,427.99
应收股利	-	-	-	-	-	-1,163,403.97	1,163,403.97
其他资产	-	-	-	-	-	75,156.17	75,156.17
资产总计	1,605,111,165.44	536,816,600.00	6,762,704,693.90	3,825,309,014.80	1,155,617,271.68	13,780,617,243.81	27,666,175,89.63

负债							
卖出回购金融资产款	400,200,000.00	-	-	-	-	-	-400,200,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-1,115,301.70	-1,115,301.70
应付赎回款	-	-	-	-	-	2.53	2.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-35,617,497.50	-35,617,497.50
应付托管费	-	-	-	-	-	-5,936,249.57	-5,936,249.57
应付交易费用	-	-	-	-	-	-2,518,950.99	-2,518,950.99
应交税费	-	-	-	-	-	580,947.08	580,947.08

其他 负债	-	-	-	-	-	210,000.00	210,000.00
负债 总计	400,200,000.00	-	-	-	-	-45,978,949.37	446,178,949.37
利率 敏感 度缺 口	1,204,911,165.44	536,816,600.00	6,762,704,693.90	3,825,309,014.80	1,155,617,271.68	13,734,638,294.44	27,219,997,040.26

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
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(2019年12月31日)	上年度末(2018年12月31日)
	利率 +1%	-910,036.27	-125,385,306.78
	利率 -1%	911,064.11	130,205,574.75

注 1: 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。

注 2: 本基金合同于 2018 年 1 月 23 日生效。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位: 人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
----	--------------------

	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,688,524,533.78	-	2,688,524,533.78
资产合计	-	2,688,524,533.78	-	2,688,524,533.78
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	-	2,688,524,533.78	-	2,688,524,533.78
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	889,975,467.45	-	889,975,467.45
资产合计	-	889,975,467.45	-	889,975,467.45
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	-	889,975,467.45	-	889,975,467.45

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	港币相对人民币升值 5%	134,426,226.69	44,498,773.37
	港币相对人民币贬值 5%	-134,426,226.69	-44,498,773.37



注：本基金合同于 2018 年 1 月 23 日生效。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合比例为：本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0—95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%），封闭期内每个交易日日终，股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0—100%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%）；权证投资比例为基金资产净值的 0%—3%；本基金封闭期届满转换为开放式基金后，每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制；封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；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：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		上年度末 2018 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	20,197,096,602.05	54.21	13,289,714,253.32	48.82
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	1,642,050,000.00	4.41	12,522,176,580.38	46.00
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	21,839,146,602.05	58.61	25,811,890,833.70	94.83

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
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 ( 2019 年 12 月 31 日 )	上年度末 ( 2018 年 12 月 31 日 )
	业绩比较基准+10%	2,385,185,278.64	1,996,786,715.85
业绩比较基准-10%	-2,385,185,278.64	-1,996,786,715.85	

注: 1、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。

2、本基金合同于 2018 年 1 月 23 日生效。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2019 年 12 月 31 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值接近。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 17,735,157,836.16 元, 第二层次的余额为 4,103,988,765.89 元, 无属于第三层次的余额 (2018 年 12 月 31 日: 第一层次 14,558,774,771.97 元, 第二层次的余额为

11,253,116,061.73 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

本基金交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债除外)本期采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,197,096,602.05	54.11
	其中：股票	20,197,096,602.05	54.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,642,050,000.00	4.40
	其中：债券	1,642,050,000.00	4.40
	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	12,599,500,000.00	33.76
	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	2,675,772,449.75	7.17
8	其他各项资产	209,082,442.58	0.56
9	合计	37,323,501,494.38	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,411,371,454.16	33.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,987,241.74	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	968,423,168.44	2.60
G	交通运输、仓储和邮政业	496,231,992.10	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,324,892.73	0.00
J	金融业	2,268,491,953.97	6.09
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	6,578.04	0.00

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	532,856,041.52	1.43
R	文化、体育和娱乐业	827,878,745.57	2.22
S	综合	-	-
	合计	17,508,572,068.27	46.99

### 8.2.2 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（%）
A 基础材料	611,724,148.91	1.64
B 消费者非必需品	1,024,400,683.27	2.75
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	3,097,772.06	0.01
H 信息技术	780,137,955.14	2.09
I 电信服务	269,163,974.40	0.72
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	2,688,524,533.78	7.22

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	92,348,731	2,293,018,990.73	6.15
2	601318	中国平安	26,492,365	2,264,037,512.90	6.08
3	600309	万华化学	34,531,700	1,939,645,589.00	5.21
4	601933	永辉超市	128,438,086	968,423,168.44	2.60
5	300413	芒果超媒	24,462,806	827,799,389.57	2.22
6	002008	大族激光	19,623,751	784,950,040.00	2.11
7	600887	伊利股份	24,802,485	767,388,885.90	2.06
8	002600	领益智造	61,787,406	670,393,355.10	1.80
9	02238	广汽集团	76,558,000	665,217,514.83	1.79
10	00968	信义光能	124,936,000	618,890,890.54	1.66
11	02899	紫金矿业	176,004,000	611,724,148.91	1.64
12	600031	三一重工	35,042,115	597,468,060.75	1.60
13	600438	通威股份	42,859,930	562,750,880.90	1.51

14	300124	汇川技术	18,143,968	546,860,754.52	1.47
15	002044	美年健康	35,786,168	532,856,041.52	1.43
16	000938	紫光股份	16,462,288	497,120,699.36	1.33
17	603589	口子窖	8,948,117	490,165,104.47	1.32
18	000651	格力电器	7,290,439	478,106,989.62	1.28
19	002511	中顺洁柔	30,235,442	382,780,695.72	1.03
20	300009	安科生物	24,581,985	370,942,153.65	1.00
21	603707	健友股份	8,865,188	367,727,998.24	0.99
22	000739	普洛药业	24,105,565	312,649,178.05	0.84
23	002120	韵达股份	9,522,189	305,184,492.10	0.82
24	603899	晨光文具	6,450,000	304,053,000.00	0.82
25	00700	腾讯控股	800,000	269,163,974.40	0.72
26	300633	开立医疗	11,179,203	264,592,951.70	0.71
27	002821	凯莱英	1,704,720	220,761,240.00	0.59
28	03690	美团点评-W	2,369,000	216,242,277.36	0.58
29	002352	顺丰控股	5,250,000	191,047,500.00	0.51
30	688363	华熙生物	1,936,098	161,470,573.20	0.43
31	00981	中芯国际	15,076,000	161,247,064.60	0.43
32	300142	沃森生物	4,026,660	130,624,850.40	0.35
33	002773	康弘药业	2,650,400	97,985,288.00	0.26
34	603025	大豪科技	9,210,000	83,718,900.00	0.22
35	603486	科沃斯	4,113,388	83,460,642.52	0.22
36	01797	新东方在线	4,409,000	73,460,588.77	0.20
37	01211	比亚迪股份	1,996,500	69,480,302.31	0.19
38	601658	邮储银行	568,984	3,274,502.89	0.01
39	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.01
40	01882	海天国际	111,000	1,877,268.23	0.01
41	00895	东江环保	238,200	1,220,503.83	0.00
42	688188	柏楚电子	7,847	1,193,450.23	0.00
43	601077	渝农商行	185,815	1,179,938.18	0.00
44	300760	迈瑞医疗	6,407	1,165,433.30	0.00
45	688001	华兴源创	21,494	893,505.58	0.00
46	688199	久日新材	4,494	268,112.04	0.00
47	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.00
48	688025	杰普特	4,655	178,565.80	0.00
49	688058	宝兰德	1,450	131,442.50	0.00
50	300788	中信出版	1,556	79,356.00	0.00
51	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00

52	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
53	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600309	万华化学	1,578,483,859.48	5.80
2	601933	永辉超市	1,019,874,008.15	3.75
3	600031	三一重工	998,531,080.26	3.67
4	601012	隆基股份	945,572,131.04	3.47
5	002008	大族激光	826,443,071.04	3.04
6	000651	格力电器	793,857,372.24	2.92
7	600887	伊利股份	736,763,728.00	2.71
8	002600	领益智造	736,029,658.07	2.70
9	300124	汇川技术	710,882,706.79	2.61
10	002415	海康威视	657,799,646.00	2.42
11	300413	芒果超媒	649,801,426.98	2.39
12	600690	海尔智家	626,423,591.74	2.30
13	000858	五粮液	613,227,763.43	2.25
14	000568	泸州老窖	609,725,735.47	2.24
15	02238	广汽集团	597,767,222.16	2.20
16	601318	中国平安	572,171,517.82	2.10
17	000938	紫光股份	571,291,928.49	2.10
18	600048	保利地产	560,601,796.56	2.06
19	000002	万科 A	552,366,514.00	2.03
20	603899	晨光文具	505,068,330.79	1.86

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

### 8.4.2 累计卖出金额超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	601012	隆基股份	2,266,699,830.41	8.33
2	601318	中国平安	1,705,741,805.58	6.27

3	600887	伊利股份	1,466,392,276.25	5.39
4	600703	三安光电	1,063,735,016.16	3.91
5	000858	五粮液	918,107,357.99	3.37
6	600519	贵州茅台	851,866,800.47	3.13
7	002271	东方雨虹	833,821,233.45	3.06
8	000568	泸州老窖	822,826,198.54	3.02
9	600004	白云机场	748,182,914.32	2.75
10	600438	通威股份	700,110,865.49	2.57
11	601933	永辉超市	660,014,291.24	2.42
12	002938	鹏鼎控股	640,517,880.82	2.35
13	600584	长电科技	605,808,485.78	2.23
14	600690	海尔智家	589,395,920.72	2.17
15	600031	三一重工	586,510,804.54	2.15
16	002415	海康威视	568,905,715.10	2.09
17	000650	仁和药业	527,672,416.17	1.94
18	600048	保利地产	523,660,894.41	1.92
19	000002	万科 A	482,345,503.20	1.77
20	603899	晨光文具	467,211,415.35	1.72

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,645,074,923.94
卖出股票收入（成交）总额	24,447,359,107.19

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	250,640,000.00	0.67
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	1,391,410,000.00	3.73
9	其他	-	-



10	合计	1,642,050,000.00	4.41
----	----	------------------	------

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	111916313	19 上海银行 CD313	5,000,000	496,950,000.00	1.33
2	111916316	19 上海银行 CD316	5,000,000	496,900,000.00	1.33
3	111970604	19 宁波银行 CD217	4,000,000	397,560,000.00	1.07
4	011901605	19 宝钢 SCP012	2,000,000	200,500,000.00	0.54
5	011901725	19 联合水泥 SCP010	500,000	50,140,000.00	0.13

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 8.12.3 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	13,833,140.78
2	应收证券清算款	174,980,548.92
3	应收股利	2,590,996.79
4	应收利息	17,677,756.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,082,442.58

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 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	300413	芒果超媒	698,505,003.65	1.87	大宗交易购入流通受限

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
303,568	107,717.52	3,776,421,878.25	11.55%	28,923,168,865.26	88.45%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	基本养老保险基金三一零组合	245,211,865.00	2.94%
2	中国人寿资产管理有限公司	170,000,000.00	2.04%
3	中信证券－民生银行－中信证券贵宾 丰元 22 号集合资产管理计划	131,632,576.00	1.58%
4	中国电信集团有限公司企业年金计划 －中国银行股份有限公司	106,426,148.00	1.27%
5	中信证券信安盈利混合型养老金产品 －中信银行股份有限公司	76,623,391.00	0.92%
6	上海宁泉资产管理有限公司－宁泉致 远 8 号私募证券投资基金	71,070,487.00	0.85%
7	永安期货－工商银行－永安期货－工 银量化永安国富 1 期集合资产管理计划	67,106,443.00	0.80%
8	中国人寿保险股份有限公司	66,715,063.00	0.80%
9	伦敦市投资管理有限公司－客户资金	64,238,590.00	0.77%
10	上海铂绅投资中心（有限合伙）－铂绅 四号证券投资基金（私募）	57,027,815.00	0.68%

注：上表所列持有人为本基金场内持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	14,030,688.92	0.0429%

### 9.4 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>100

本基金基金经理持有本开放式基金	50~100
-----------------	--------

注：本基金的基金经理之一也是本公司投资部门负责人，故上述两点统计数据有重合部分。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年1月23日）基金份额总额	32,699,592,445.33
本报告期期初基金份额总额	32,699,591,962.80
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	1,219.29
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	32,699,590,743.51

注：卖出/赎回总份额含低于最低持有份额强制赎回的份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人重大人事变动

自 2019 年 4 月 12 日起詹鸿飞先生任公司副总经理暨首席信息官，严长胜先生任公司副总经理。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门重大人事变动

自 2019 年 12 月 18 日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2018 年起连续 2 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 10.0 万元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	9,216,030,286.43	20.18%	8,654,274.59	26.20%	-

中投证券	4	9,078,892,991.51	19.88%	5,743,469.57	17.39%	新增 2 个
广发证券	4	5,634,206,198.08	12.34%	3,948,682.02	11.96%	-
中信证券	3	4,813,226,323.50	10.54%	3,155,222.80	9.55%	-
长江证券	2	3,686,627,037.74	8.07%	2,344,257.90	7.10%	-
华泰证券	2	2,302,044,927.78	5.04%	1,469,323.25	4.45%	-
国信证券	2	1,643,128,250.89	3.60%	1,160,210.63	3.51%	-
安信证券	2	1,578,625,083.71	3.46%	1,171,091.80	3.55%	-
银河证券	1	1,463,900,628.38	3.21%	1,070,545.57	3.24%	-
招商证券	2	1,242,374,488.62	2.72%	912,481.00	2.76%	-
国泰君安	2	938,084,877.14	2.05%	686,017.65	2.08%	-
中信建投	5	674,732,854.21	1.48%	463,965.43	1.40%	新增 2 个
华创证券	1	592,440,577.69	1.30%	433,253.65	1.31%	-
中泰证券	2	541,868,524.75	1.19%	346,838.00	1.05%	-
国都证券	2	453,888,415.29	0.99%	286,541.94	0.87%	-
国金证券	2	416,235,765.89	0.91%	262,770.14	0.80%	-
南京证券	1	410,680,000.00	0.90%	265,262.32	0.80%	-
华福证券	1	281,028,580.22	0.62%	180,542.82	0.55%	新增
东方证券	1	257,869,160.13	0.56%	188,578.60	0.57%	-
天风证券	2	229,251,208.99	0.50%	146,345.85	0.44%	-
万联证券	1	128,833,827.95	0.28%	81,405.64	0.25%	-
国盛证券	2	72,727,725.09	0.16%	45,907.74	0.14%	新增
太平洋证券	2	12,965,066.10	0.03%	8,374.27	0.03%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	退租 1 个
爱建证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

德邦证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中原证券	1	-	-	-	-	退租
民生证券	1	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	2,480,566,582.08	34.55%	5,500,000,000.00	16.22%	-	-
中投证券	570,413,321.84	7.95%	1,634,000,000.00	4.82%	-	-
广发证券	892,514,555.90	12.43%	4,200,000,000.00	12.38%	-	-
中信证券	597,162,719.85	8.32%	400,000,000.00	1.18%	-	-
长江证券	1,457,656,956.37	20.30%	7,599,500,000.00	22.41%	-	-
华泰证券	158,724,629.00	2.21%	-	-	-	-
国信证券	133,740,330.52	1.86%	4,000,000,000.00	11.79%	-	-
安信证券	164,145,208.77	2.29%	-	-	-	-
银河证券	142,429,165.40	1.98%	4,000,000,000.00	11.79%	-	-
招商证券	342,220,550.16	4.77%	4,580,000,000.00	13.50%	-	-
国泰君安	93,122,369.56	1.30%	-	-	-	-
中信建投	11,415,247.60	0.16%	-	-	-	-
华创证券	93,628,117.30	1.30%	2,000,000,000.00	5.90%	-	-
中泰证券	25,448,917.46	0.35%	-	-	-	-
国都证券	375,399.50	0.01%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-



南京证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	3,589,045.54	0.05%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	11,921,570.80	0.17%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
西藏东方 财富	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	旗下各基金 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	本公司网站及《上海证券报》	2019 年 1 月 1 日
2	关于长期停牌股票(长春高新)估值方法调整的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019 年 2 月 27 日
3	关于长期停牌股票(格力电器)估值方法调整的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019 年 4 月 3 日
4	关于增聘副总经理的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019 年 4 月 12 日
5	关于长期停牌股票(隆基股	本公司网站及《上海证券报》	2019 年 4 月 13 日

	份) 估值方法调整的公告		
6	关于旗下部分基金可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019年6月22日
7	关于调整网上直销部分基金转换/赎回申购优惠费率的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019年6月27日
8	关于旗下基金所持证券(中科曙光)调整估值价的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019年6月27日
9	旗下各基金 2019 年 6 月 30 日资产净值公告	本公司网站及《上海证券报》	2019年7月1日
10	关于调整农业银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019年7月19日
11	关于网上直销平台开通赎回申购业务的公告	本公司网站及《上海证券报》	2019年7月26日
12	关于增加西藏东方财富证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定网站、本公司网站及《上海证券报》	2019年9月2日
13	关于旗下部分基金在部分销售机构开通转换业务的公告	中国证监会指定网站、本公司网站及《上海证券报》	2019年9月5日
14	关于调整旗下部分基金最低申购、追加申购、定期定额投资金额及最低赎回、转换转出、持有份额的公告	中国证监会指定网站、本公司网站及《上海证券报》	2019年10月18日
15	关于厦门分公司变更办公地址的公告	中国证监会指定网站、本公司网站及《上海证券报》	2019年11月1日
16	关于提醒投资者及时提供	中国证监会指定网站、本公司	2019年11月18日

	或更新身份信息资料的公告	网站及《上海证券报》	
17	关于调整旗下基金在部分销售机构费率优惠活动的公告	中国证监会指定网站、本公司网站及《上海证券报》	2019年12月30日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金的封闭期自 2018 年 1 月 23 日（基金合同生效日）起至 2020 年 1 月 22 日止，在此期间投资者不能申购、赎回基金份额。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 2、《兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全合宜灵活配置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宜灵活配置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

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

基金管理人客户服务中心电话: 400-678-0099, 021-38824536

兴证全球基金管理有限公司

2020年3月24日