

兴全合泰混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
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
§5 托管人报告	16
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 市场中性策略执行情况.....	50
7.13 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56

§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全合泰混合型证券投资基金	
基金简称	兴全合泰混合	
场内简称	-	
基金主代码	007802	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 17 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,962,760,734.75 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	007802	007803
报告期末下属分级基金的份额总额	5,822,014,674.08 份	1,140,746,060.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。	
投资策略	本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及其他品种的投资策略等。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C
下属分级基金的风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

注：本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	兴证全球基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.xqfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴证全球基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-30 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	249,525,387.70	45,630,238.77
本期利润	589,063,780.00	104,520,156.67
加权平均基金份额本期利润	0.0869	0.0739
本期加权平均净值利润率	8.00%	6.83%
本期基金份额净值增长率	9.94%	9.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	261,202,926.76	45,921,760.98
期末可供分配基金份额利润	0.0449	0.0403
期末基金资产净值	6,896,923,170.19	1,345,704,726.73
期末基金份额净值	1.1846	1.1797
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	18.46%	17.97%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全合泰混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.08%	0.83%	5.52%	0.78%	4.56%	0.05%
过去三个月	16.79%	1.06%	8.20%	0.80%	8.59%	0.26%
过去六个月	9.94%	1.67%	-0.99%	1.22%	10.93%	0.45%
自基金合同生效起至今	18.46%	1.40%	2.79%	1.06%	15.67%	0.34%

兴全合泰混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.04%	0.84%	5.52%	0.78%	4.52%	0.06%
过去三个月	16.62%	1.06%	8.20%	0.80%	8.42%	0.26%

过去六个月	9.62%	1.68%	-0.99%	1.22%	10.61%	0.46%
自基金合同生效起至今	17.97%	1.40%	2.79%	1.06%	15.18%	0.34%

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

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

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

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

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

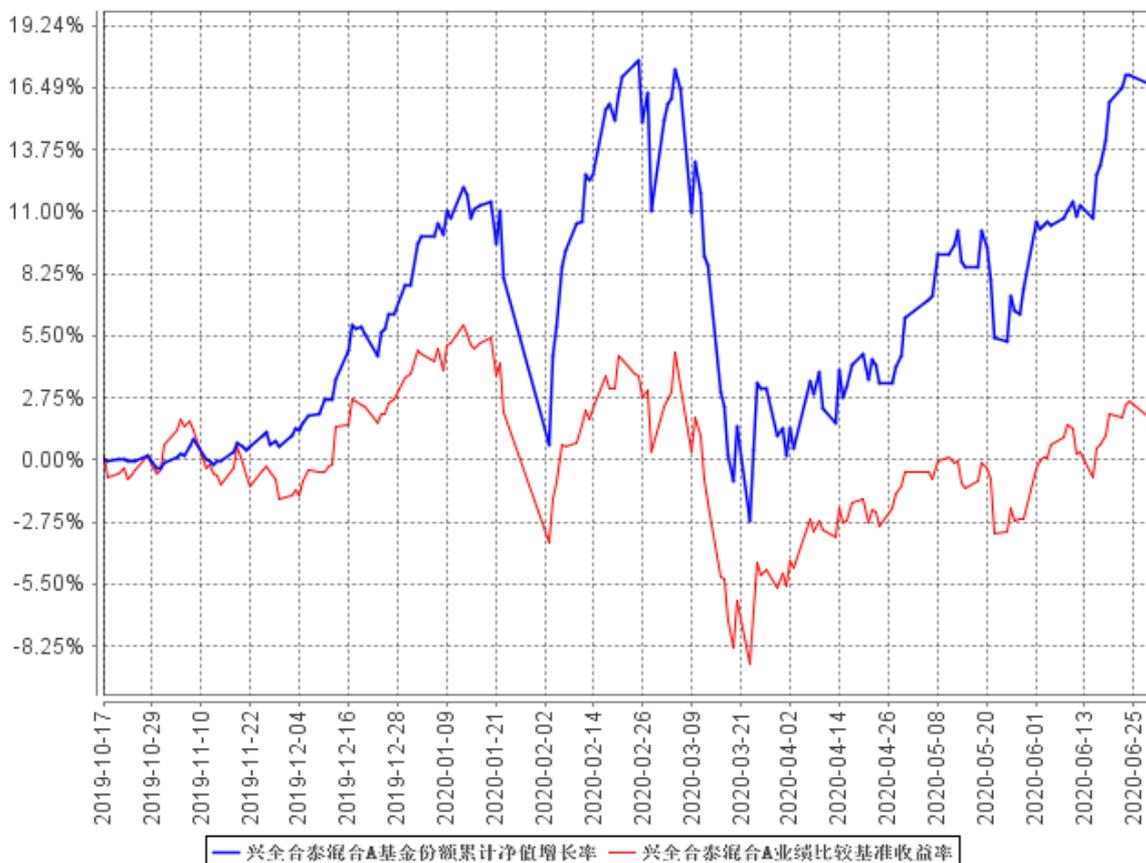
$$\text{Return } t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数收益率 } t / \text{沪深 300 指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率 } t / \text{恒生指数收益率 } t-1 - 1) + 20\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率 } t / \text{中债综合（全价）指数收益率 } t-1 - 1)$$

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

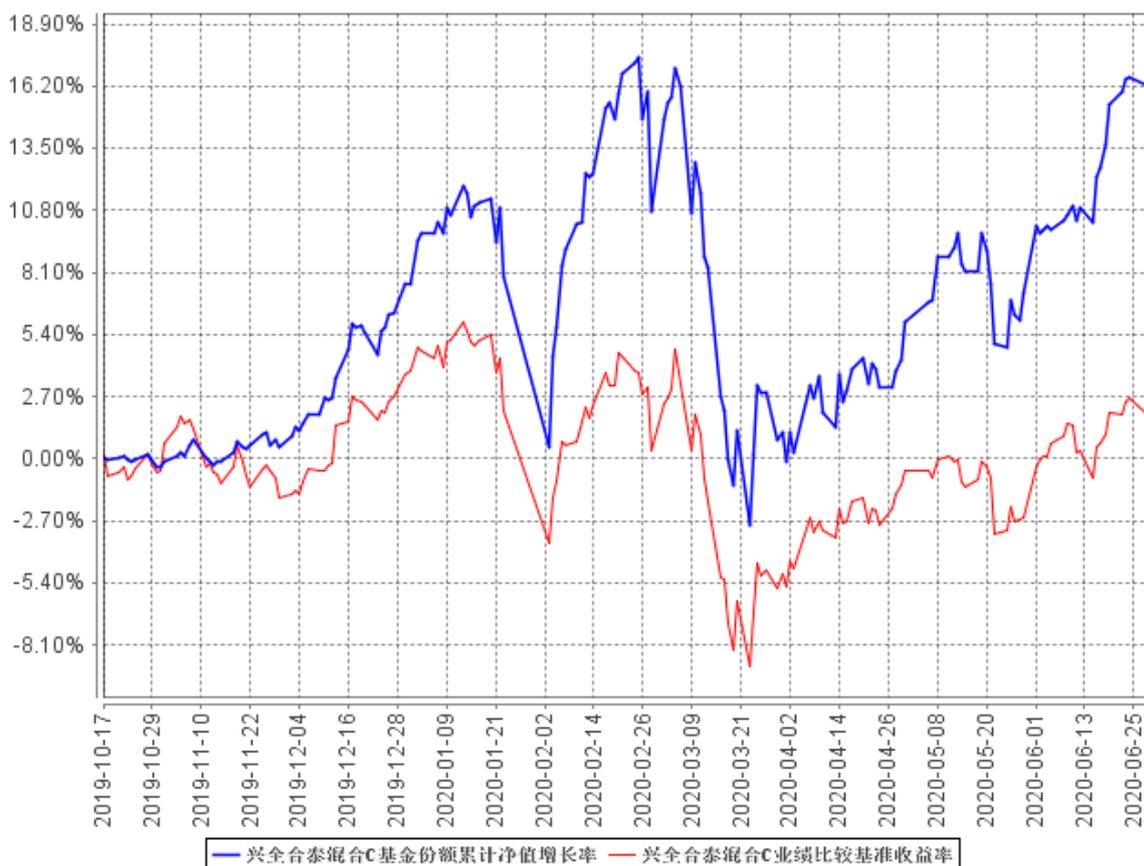
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$, T 表示时间截至日。

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

兴全合泰混合A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



兴全合泰混合C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



- 1、净值表现所取数据截至到 2020 年 6 月 30 日。
- 2、按照《兴全合泰混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的建仓期为 2019 年 10 月 17 日到 2020 年 4 月 16 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、本基金基金合同生效日为 2019 年 10 月 17 日，截至本报告期末不满 1 年。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2020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、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（LOF）、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、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、兴全恒鑫债券型证券投资基金、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金共31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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
任相栋	本基金基金经理	2019 年 10 月 17 日	-	9	金融学硕士。历任交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理，金鹰基金管理有限公司权益部上海权益总监。现任兴全合泰混合型证券投资基金基金经理。

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、“证券从业年限”按其从事证券投资、研究等业务的年限计算。

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

本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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，原因为合规调整，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金报告期内坚持与一季度相仿的投资策略，坚持自身的投资理念，坚持自下而上，并尽量降低换手，上半年消费医药等部分板块表现相对极致，投资者抱团现象明显，本基金对市场热点的呼应较少，相对回避高估值资产，这使得基金相对收益短期落后。上半年市场的主要特征为充裕的流动性但行业基本面趋势乏善可陈，这使得部分所谓长期确定的“优质资产”从长期看已经出现了明显的泡沫。报告期内本基金涨幅表现好于业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全合泰混合 A 基金份额净值为 1.1846 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.94%；截至本报告期末兴全合泰混合 C 基金份额净值为 1.1797 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.62%；同期业绩比较基准收益率为-0.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，市场的核心要素在于流动性的宽松程度和经济复苏的幅度，在这背后疫情和疫苗的接种效果仍是重要影响因素，从偏乐观的角度，资本市场对疫情担忧的拐点已经在上半年出现，这也使得市场的结构性机会有望转向业绩复苏但股价前期滞涨的板块。由于过去两年的赚钱效应，市场热度有望维持，经济复苏在未来几个季度有望维持，本基金将更加积极地把握市场的结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全合泰混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	188,971,010.31	609,583,728.50
结算备付金		12,102,621.03	124,985,961.62
存出保证金		5,725,008.40	12,007,505.81
交易性金融资产	6.4.7.2	7,908,349,005.32	7,512,886,885.91
其中：股票投资		7,457,404,005.32	7,511,479,885.91
基金投资		-	-
债券投资		450,945,000.00	1,407,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		248,205,177.25	102,647,665.65
应收利息	6.4.7.5	7,802,091.66	213,602.21
应收股利		4,490,336.51	-
应收申购款		11,445,760.22	58,611,171.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,387,091,010.70	8,420,936,520.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10,547,689.09	78,463,806.53
应付赎回款		112,740,508.03	39,842,872.61
应付管理人报酬		10,278,539.40	8,592,950.98
应付托管费		1,713,089.92	1,432,158.49
应付销售服务费		687,926.84	448,233.46
应付交易费用	6.4.7.7	8,143,450.75	6,625,921.74
应交税费		-	73.55

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	351,909.75	130,452.26
负债合计		144,463,113.78	135,536,469.62
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,962,760,734.75	7,690,925,195.48
未分配利润	6.4.7.10	1,279,867,162.17	594,474,855.68
所有者权益合计		8,242,627,896.92	8,285,400,051.16
负债和所有者权益总计		8,387,091,010.70	8,420,936,520.78

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，兴全合泰混合 A 基金份额净值 1.1846 元，基金份额总额 5,822,014,674.08 份；兴全合泰混合 C 基金份额净值 1.1797 元，基金份额总额 1,140,746,060.67 份。兴全合泰混合份额总额合计为 6,962,760,734.75 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全合泰混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		812,744,639.32	-
1.利息收入		6,873,707.82	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,623,695.62	-
债券利息收入		5,250,012.20	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		390,773,274.20	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	331,601,587.61	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,345,886.34	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	50,825,800.25	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	398,428,310.20	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	16,669,347.10	-
减：二、费用		119,160,702.65	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	66,358,711.34	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,059,785.25	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,565,995.20	-
4. 交易费用	6.4.7.19	36,959,633.65	-
5. 利息支出		83,046.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		83,046.66	-
6. 税金及附加		27.40	-
7. 其他费用	6.4.7.20	133,503.15	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		693,583,936.67	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		693,583,936.67	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全合泰混合型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30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）	7,690,925,195.48	594,474,855.68	8,285,400,051.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	693,583,936.67	693,583,936.67
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）	-728,164,460.73	-8,191,630.18	-736,356,090.91
其中：1.基金申购款	4,488,617,876.80	454,747,893.00	4,943,365,769.80
2.基金赎回款	-5,216,782,337.53	-462,939,523.18	-5,679,721,860.71
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)	6,962,760,734.75	1,279,867,162.17	8,242,627,896.92
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全合泰混合型证券投资基金系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》《兴全合泰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证监许可【2019】1340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5,939,822,781.28份,经德勤华

永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了验资报告。本基金基金合同于 2019 年 10 月 17 日正式生效。本基金的管理人为兴证全球基金管理有限公司，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、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 50%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%）；每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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》、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》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。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）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。

(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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	188,971,010.31
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：	188,971,010.31

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,600,518,349.77	7,457,404,005.32	856,885,655.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	450,589,700.00	450,945,000.00
	合计	450,589,700.00	450,945,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	7,051,108,049.77	7,908,349,005.32	857,240,955.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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**

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	16,112.56
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	9,135.27
应收债券利息	7,774,426.23
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	2,417.60
合计	7,802,091.66

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,143,305.76
银行间市场应付交易费用	144.99
合计	8,143,450.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	262,402.15
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	351,909.75

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全合泰混合 A		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,539,506,544.63	6,539,506,544.63
本期申购	3,293,785,789.87	3,293,785,789.87
本期赎回(以“-”号填列)	-4,011,277,660.42	-4,011,277,660.42
- 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	5,822,014,674.08	5,822,014,674.08

金额单位：人民币元

兴全合泰混合 C		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,151,418,650.85	1,151,418,650.85
本期申购	1,194,832,086.93	1,194,832,086.93
本期赎回(以“-”号填列)	-1,205,504,677.11	-1,205,504,677.11
- 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	1,140,746,060.67	1,140,746,060.67

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全合泰混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,564,970.82	475,197,194.04	506,762,164.86
本期利润	249,525,387.70	339,538,392.30	589,063,780.00
本期基金份额交易产生的变动数	-19,887,431.76	-1,030,016.99	-20,917,448.75
其中：基金申购款	40,710,475.47	295,829,318.20	336,539,793.67
基金赎回款	-60,597,907.23	-296,859,335.19	-357,457,242.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	261,202,926.76	813,705,569.35	1,074,908,496.11

单位：人民币元

兴全合泰混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,119,241.18	83,593,449.64	87,712,690.82
本期利润	45,630,238.77	58,889,917.90	104,520,156.67
本期基金份额交易产生的变动数	-3,827,718.97	16,553,537.54	12,725,818.57
其中：基金申购款	12,011,394.29	106,196,705.04	118,208,099.33
基金赎回款	-15,839,113.26	-89,643,167.50	-105,482,280.76

本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,921,760.98	159,036,905.08	204,958,666.06

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	1,210,490.98
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	359,229.90
其他	53,974.74
合计	1,623,695.62

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	14,078,944,352.69
减：卖出股票成本总额	13,747,342,765.08
买卖股票差价收入	331,601,587.61

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30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	8,345,886.34
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	8,345,886.34

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	92,821,661.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	84,461,191.90
减：应收利息总额	14,583.53
买卖债券差价收入	8,345,886.34

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,825,800.25
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	50,825,800.25

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	398,428,310.20
——股票投资	398,073,010.20
——债券投资	355,300.00
——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	398,428,310.20

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	16,535,989.97
基金转换费收入	133,357.13
合计	16,669,347.10

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	36,957,308.65
银行间市场交易费用	2,325.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	36,959,633.65

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费用	4,500.00
银行费用	39,495.55
合计	133,503.15

6.4.7.21 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

截至财务报表批准日，本基金无须做披露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（以下简称“兴证全球基金”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
兴业证券	3,098,468,478.02	11.34%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	2,909,294.49	15.51%	1,116,699.26	13.71%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	66,358,711.34
其中：支付销售机构的客户维护费	27,390,576.30	-

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,059,785.25	-

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C	合计
兴证全球基金	-	115,379.20	115,379.20
招商银行	-	352,894.43	352,894.43
兴业证券	-	389,042.51	389,042.51
合计	-	857,316.14	857,316.14
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C	合计
合计	-	-	-

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末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**

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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固有资金投资本基金的情况**

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	188,971,010.31	1,210,490.98	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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	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
002064	华峰氨纶	2020年2月4日	2021年2月8日	非公开发行流通受限	5.43	4.71	2,974,217	16,149,998.31	14,008,562.07	
002064	华峰氨纶	2020年2月4日	2022年2月7日	非公开发行流通受限	5.43	4.57	2,974,218	16,150,003.74	13,592,176.26	
603799	华友钴业	2020年6月8日	2020年12月8日	大宗交易购入流通受限	31.88	35.15	1,000,000	31,880,000.00	35,150,000.00	
603799	华友钴业	2020年6月17日	2020年12月17日	大宗交易购入流通受限	33.37	35.10	1,000,000	33,370,000.00	35,100,000.00	
603899	晨光文具	2020年2月28日	2020年8月28日	大宗交易购入流通受限	43.30	52.96	2,350,000	101,755,000.00	124,456,000.00	
000710	贝瑞基因	2020年5月6日	2020年11月6日	大宗交易购入流通受限	39.97	54.68	750,000	29,977,500.00	41,010,000.00	
000710	贝瑞基因	2020年5月29日	2020年11月30日	大宗交易购入流通	49.27	54.48	250,000	12,317,500.00	13,620,000.00	

				受限						
000710	贝瑞基因	2020年6月3日	2020年12月3日	大宗交易购入流通受限	50.48	54.42	750,000	37,860,000.00	40,815,000.00	-
000938	紫光股份	2020年2月10日	2020年8月10日	大宗交易购入流通受限	33.76	41.89	920,000	31,059,200.00	38,538,800.00	-
000938	紫光股份	2020年3月6日	2020年9月7日	大宗交易购入流通受限	43.56	41.45	1,000,000	43,560,000.00	41,450,000.00	-
000938	紫光股份	2020年3月10日	2020年9月10日	大宗交易购入流通受限	40.71	41.44	1,000,000	40,710,000.00	41,440,000.00	-
002212	南洋股份	2020年2月21日	2020年8月21日	大宗交易购入流通受限	23.29	25.73	2,780,000	64,746,200.00	71,529,400.00	-
002212	南洋股份	2020年2月24日	2020年8月24日	大宗交易购入流通受限	24.16	25.71	2,000,000	48,320,000.00	51,420,000.00	-
002558	巨人网络	2020年2月12日	2020年8月12日	大宗交易购入流通受限	16.37	17.09	3,000,000	49,110,000.00	51,270,000.00	-
002773	康弘药业	2019年12月31日	2020年7月1日	大宗交易购入流通受限	33.46	49.60	550,000	18,403,000.00	27,280,000.00	-
300271	华宇软	2020年2月6日	2020年8月6日	大宗交易购入	26.17	27.43	460,000	12,038,200.00	12,617,800.00	-

	件		日	流通受限						
300413	芒果超媒	2020年3月6日	2020年9月7日	大宗交易购入流通受限	43.46	62.14	835,638	36,316,827.48	51,926,545.32	-
300450	先导智能	2020年6月1日	2020年12月1日	大宗交易购入流通受限	40.32	42.08	1,000,000	40,320,000.00	42,080,000.00	-
688233	神工股份	2020年2月13日	2020年8月21日	新股流通受限	21.67	49.26	11,858	256,962.86	584,125.08	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股 流通 受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
--------	----------	-----------------------	-------------------------	----------------	------	------	-------	----------	----------	---

上述流通受限证券可流通日系本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。

6.4.12.2 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。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参加因转融通证券业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险，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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	1,407,000.00
未评级	-	-
合计	-	1,407,000.00

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易。因此，除在附注 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。

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

例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	188,971,010.31	-	-	-	-	-	188,971,010.31
结算备付金	12,102,621.03	-	-	-	-	-	12,102,621.03
存出保证金	5,725,008.40	-	-	-	-	-	5,725,008.40
交易性金融资产	-	-	450,945,000.00	-	-	-7,457,404,005.32	27,908,349,005.32
应收证券清算款	-	-	-	-	-	248,205,177.25	248,205,177.25
应收利息	-	-	-	-	-	7,802,091.66	7,802,091.66
应收股利	-	-	-	-	-	4,490,336.51	4,490,336.51
应收申购款	250,966.12	-	-	-	-	11,194,794.10	11,445,760.22
资产总计	207,049,605.86	-	450,945,000.00	-	-	-7,729,096,404.84	28,387,091,010.70
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	10,547,689.09	10,547,689.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	112,740,508.03	112,740,508.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	10,278,539.40	10,278,539.40
应付托管费	-	-	-	-	-	1,713,089.92	1,713,089.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	687,926.84	687,926.84
应付交易费用	-	-	-	-	-	8,143,450.75	8,143,450.75
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	351,909.75	351,909.75
负债总计	-	-	-	-	-	144,463,113.78	144,463,113.78
利率敏感度缺口	207,049,605.86	-	450,945,000.00	-	-	-7,584,633,291.06	28,242,627,896.92
上年度末 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	609,583,728.50	-	-	-	-	-	609,583,728.50
结算备付金	124,985,961.62	-	-	-	-	-	124,985,961.62

存出保证金	12,007,505.81	-	-	-	-	-	12,007,505.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-1,407,000.00	7,511,479,885.91	7,512,886,885.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	102,647,665.65	102,647,665.65
应收利息	-	-	-	-	-	213,602.21	213,602.21
应收申购款	4,009,957.42	-	-	-	-	54,601,213.66	58,611,171.08
资产总计	750,587,153.35	-	-	-	-1,407,000.00	7,668,942,367.43	8,420,936,520.78
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	78,463,806.53	78,463,806.53
应付赎回款	-	-	-	-	-	39,842,872.61	39,842,872.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	8,592,950.98	8,592,950.98
应付托管费	-	-	-	-	-	1,432,158.49	1,432,158.49
应付销售服务费	-	-	-	-	-	448,233.46	448,233.46
应付交易费用	-	-	-	-	-	6,625,921.74	6,625,921.74
应交税费	-	-	-	-	-	73.55	73.55
其他负债	-	-	-	-	-	130,452.26	130,452.26
负债总计	-	-	-	-	-	135,536,469.62	135,536,469.62
利率敏感度缺口	750,587,153.35	-	-	-	-1,407,000.00	7,533,405,897.81	8,285,400,051.16

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(2020年6月30日)	上年度末(2019年12月31日)
	利率+1%	-1,464,840.72	-
	利率-1%	1,474,418.79	-

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	40,454,890.06	-
	港币相对人民币贬值 5%	-40,454,890.06	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	7,457,404,005.32	90.47	7,511,479,885.91	90.66
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	450,945,000.00	5.47	1,407,000.00	0.02
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	7,908,349,005.32	95.94	7,512,886,885.91	90.68

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 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 10%	1,042,500,583.20	844,699,488.59
	业绩比较基准下降 10%	-1,042,500,583.20	-844,699,488.59

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 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	7,457,404,005.32	88.92
	其中：股票	7,457,404,005.32	88.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	450,945,000.00	5.38
	其中：债券	450,945,000.00	5.38
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	201,073,631.34	2.40
8	其他各项资产	277,668,374.04	3.31
9	合计	8,387,091,010.70	100.00

7.2 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	329,798,502.00	4.00
C	制造业	3,893,927,280.89	47.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	488,794,032.44	5.93
G	交通运输、仓储和邮政业	29,404,303.50	0.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	712,570,739.18	8.64
J	金融业	26,562,232.40	0.32
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	95,445,000.00	1.16

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	538,694,260.83	6.54
R	文化、体育和娱乐业	533,097,086.52	6.47
S	综合	-	-
	合计	6,648,306,204.08	80.66

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	150.72	0.00
B 消费者非必需品	445,151,458.15	5.40
C 消费者常用品	136,533,703.68	1.66
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	143,304,120.96	1.74
G 工业	-	-
H 信息技术	84,108,367.73	1.02
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	809,097,801.24	9.82

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	占基金资产净值比例（%）
1	002044	美年健康	37,383,363	538,694,260.83	6.54
2	601933	永辉超市	52,110,238	488,794,032.44	5.93
3	300207	欣旺达	22,667,244	428,410,911.60	5.20
4	000938	紫光股份	7,948,392	337,549,088.16	4.10
5	300413	芒果超媒	5,213,740	337,378,795.72	4.09
6	601899	紫金矿业	74,954,205	329,798,502.00	4.00
7	002212	南洋股份	12,547,867	329,419,304.86	4.00
8	02238	广汽集团	62,686,000	320,082,840.11	3.88
9	300271	华宇软件	10,463,989	294,830,329.69	3.58
10	002773	康弘药业	5,560,784	275,814,886.40	3.35
11	000333	美的集团	4,588,367	274,338,462.93	3.33
12	600201	生物股份	9,342,088	260,083,729.92	3.16

13	600176	中国巨石	25,996,049	237,863,848.35	2.89
14	300450	先导智能	5,038,823	228,714,010.83	2.77
15	600967	内蒙一机	20,314,396	211,066,574.44	2.56
16	300144	宋城演艺	11,313,196	195,718,290.80	2.37
17	603799	华友钴业	4,989,436	186,419,482.96	2.26
18	600804	鹏博士	20,166,034	181,090,985.32	2.20
19	300136	信维通信	3,350,476	177,642,237.52	2.16
20	600885	宏发股份	4,255,014	170,711,161.68	2.07
21	603612	索通发展	14,751,940	168,467,154.80	2.04
22	688188	柏楚电子	962,862	157,042,792.20	1.91
23	01066	威高股份	9,100,000	143,304,120.96	1.74
24	00291	华润啤酒	3,460,000	136,533,703.68	1.66
25	600426	华鲁恒升	7,246,578	128,119,499.04	1.55
26	02020	安踏体育	2,001,761	125,068,618.04	1.52
27	603899	晨光文具	2,350,036	124,457,965.60	1.51
28	000710	贝瑞基因	1,750,000	95,445,000.00	1.16
29	603833	欧派家居	731,556	84,787,340.40	1.03
30	01347	华虹半导体	3,423,000	84,108,367.73	1.02
31	601012	隆基股份	1,500,894	61,131,412.62	0.74
32	600309	万华化学	1,139,924	56,984,800.76	0.69
33	002558	巨人网络	3,000,000	51,270,000.00	0.62
34	600732	爱旭股份	4,321,561	46,629,643.19	0.57
35	600438	通威股份	1,761,746	30,619,145.48	0.37
36	002120	韵达股份	1,202,630	29,404,303.50	0.36
37	002624	完美世界	488,305	28,145,900.20	0.34
38	002064	华峰氨纶	5,948,435	27,600,738.33	0.33
39	300059	东方财富	1,314,962	26,562,232.40	0.32
40	603290	斯达半导	97,800	20,518,440.00	0.25
41	600702	舍得酒业	378,200	14,125,770.00	0.17
42	002332	仙琚制药	679,242	11,438,435.28	0.14
43	688233	神工股份	11,858	584,125.08	0.01
44	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
45	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
46	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
47	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
48	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
49	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
50	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
51	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00

52	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
53	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
54	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
55	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
56	002920	德赛西威	79	4,845.07	0.00
57	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
58	002050	三花智控	130	2,847.00	0.00
59	03323	中国建材	20	150.72	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300450	先导智能	541,424,936.32	6.53
2	600104	上汽集团	419,531,896.15	5.06
3	300207	欣旺达	385,677,695.40	4.65
4	002212	南洋股份	356,643,420.20	4.30
5	002044	美年健康	301,389,646.87	3.64
6	601933	永辉超市	293,519,483.45	3.54
7	601318	中国平安	289,958,183.76	3.50
8	000333	美的集团	289,758,673.17	3.50
9	601012	隆基股份	288,490,189.78	3.48
10	300144	宋城演艺	272,221,941.33	3.29
11	002050	三花智控	266,961,300.10	3.22
12	01918	融创中国	266,535,432.12	3.22
13	000938	紫光股份	247,299,609.39	2.98
14	600406	国电南瑞	235,371,775.05	2.84
15	002600	领益智造	217,732,148.43	2.63
16	00700	腾讯控股	214,480,458.07	2.59
17	300136	信维通信	210,419,986.94	2.54
18	600176	中国巨石	209,028,896.11	2.52
19	002405	四维图新	204,891,441.21	2.47
20	300010	豆神教育	187,178,915.23	2.26
21	000998	隆平高科	183,780,297.68	2.22
22	000002	万科A	179,003,335.14	2.16

23	03323	中国建材	178,820,607.95	2.16
24	300118	东方日升	175,592,793.41	2.12
25	600879	航天电子	174,954,222.60	2.11
26	603799	华友钴业	174,826,565.12	2.11
27	000710	贝瑞基因	168,129,101.71	2.03

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	601318	中国平安	871,136,049.39	10.51
2	002600	领益智造	684,039,414.66	8.26
3	000002	万科A	650,136,133.24	7.85
4	00700	腾讯控股	465,216,383.83	5.61
5	601012	隆基股份	422,704,863.35	5.10
6	600104	上汽集团	401,022,653.29	4.84
7	300450	先导智能	363,011,398.33	4.38
8	601688	华泰证券	350,347,144.39	4.23
9	002050	三花智控	314,956,457.04	3.80
10	000938	紫光股份	312,200,067.33	3.77
11	600309	万华化学	291,111,108.58	3.51
12	300413	芒果超媒	276,516,578.26	3.34
13	01918	融创中国	262,915,133.65	3.17
14	300010	豆神教育	237,417,828.43	2.87
15	600038	中直股份	234,286,880.14	2.83
16	600406	国电南瑞	222,212,980.23	2.68
17	600529	山东药玻	221,808,062.66	2.68
18	000725	京东方A	200,853,709.00	2.42
19	002405	四维图新	200,165,470.71	2.42
20	03323	中国建材	197,294,453.07	2.38
21	601933	永辉超市	196,220,053.10	2.37
22	300118	东方日升	184,744,549.71	2.23
23	000998	隆平高科	183,996,854.28	2.22
24	601899	紫金矿业	179,363,692.97	2.16

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	13,295,193,874.29
卖出股票收入（成交）总额	14,078,944,352.69

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	450,945,000.00	5.47
	其中：政策性金融债	450,945,000.00	5.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	450,945,000.00	5.47

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

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	190307	19 进出 07	4,500,000	450,945,000.00	5.47

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

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

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

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股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未持有国债期货，故此项不适用。

7.12 市场中性策略执行情况

本基金不属于中性策略基金，故此项不适用。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	5,725,008.40
2	应收证券清算款	248,205,177.25
3	应收股利	4,490,336.51

4	应收利息	7,802,091.66
5	应收申购款	11,445,760.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	277,668,374.04

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末不存在处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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	002212	南洋股份	122,949,400.00	1.49	大宗交易购入流通受限
2	000938	紫光股份	121,428,800.00	1.47	大宗交易购入流通受限
3	300413	芒果超媒	51,926,545.32	0.63	大宗交易购入流通受限
4	002773	康弘药业	27,280,000.00	0.33	大宗交易购入流通受限
5	300271	华宇软件	12,617,800.00	0.15	大宗交易购入流通受限

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴全合泰混合 A	257,011	22,652.78	78,562,397.61	1.35%	5,743,452,276.47	98.65%
兴全合泰混合 C	93,901	12,148.39	6,317,017.25	0.55%	1,134,429,043.42	99.45%
合计	350,912	19,841.90	84,879,414.86	1.22%	6,877,881,319.89	98.78%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴全合泰混合 A	8,392,798.38	0.1442%
	兴全合泰混合 C	327,681.41	0.0287%
	合计	8,720,479.79	0.1252%

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的情况

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	兴全合泰混合 A	>100
	兴全合泰混合 C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全合泰混合 A	>100
	兴全合泰混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全合泰混合 A	兴全合泰混合 C
基金合同生效日（2019 年 10 月 17 日）基金份额总额	5,223,614,215.98	716,208,565.30
本报告期期初基金份额总额	6,539,506,544.63	1,151,418,650.85
本报告期基金总申购份额	3,293,785,789.87	1,194,832,086.93
减：本报告期基金总赎回份额	4,011,277,660.42	1,205,504,677.11
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	5,822,014,674.08	1,140,746,060.67

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- (1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。
(2) 报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为本基金提供审计服务的审计机构——德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	5	6,005,204,061.26	21.97%	3,862,394.69	20.59%	-
兴业证券	2	3,098,468,478.02	11.34%	2,909,294.49	15.51%	-
长江证券	2	2,568,764,042.34	9.40%	1,643,221.60	8.76%	-
中信证券	5	2,492,462,476.29	9.12%	1,612,922.60	8.60%	新增部分席位
广发证券	4	2,276,898,206.95	8.33%	1,525,257.27	8.13%	-
国信证券	2	1,546,835,383.22	5.66%	1,070,688.64	5.71%	-
国盛证券	2	1,312,855,202.66	4.80%	837,482.80	4.47%	-
中泰证券	2	1,263,098,233.30	4.62%	816,546.08	4.35%	-
东方证券	1	1,059,388,710.58	3.88%	774,711.16	4.13%	-

国金证券	2	886,537,318.83	3.24%	566,891.93	3.02%	-
华泰证券	2	794,380,731.50	2.91%	501,487.37	2.67%	-
西藏东方财富	2	669,099,268.63	2.45%	288,584.31	1.54%	-
华创证券	1	622,072,657.63	2.28%	455,380.65	2.43%	-
天风证券	2	619,130,927.04	2.27%	396,813.05	2.12%	-
中投证券	4	579,288,728.07	2.12%	369,545.92	1.97%	-
国泰君安	2	551,387,393.39	2.02%	403,233.25	2.15%	-
安信证券	2	380,513,279.41	1.39%	285,427.78	1.52%	-
银河证券	1	360,508,984.82	1.32%	263,642.40	1.41%	-
招商证券	2	150,171,321.29	0.55%	109,819.69	0.59%	-
国都证券	2	96,439,000.00	0.35%	62,290.91	0.33%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	新增
东吴证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	160,922,628.01	98.86%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,858,378.66	1.14%	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加长城证券、民生证券、方正证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020 年 1 月 13 日
2	关于 2020 年春节假期延长至 2 月 2 日暨 2020 年 1 月 31 日相关业务安排的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020 年 1 月 31 日
3	关于恢复接受兴全合泰混合	上海证券报及规定	2020 年 2 月 3 日

	型证券投资基金一万元以上申购和转换转入申请的公告	互联网网站	
4	关于使用自有资金购买本公司旗下偏股型公募基金的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年2月3日
5	关于旗下部分基金投资华峰氨纶(002064)非公开发行股票的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年2月6日
6	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停接受一万元以上申购和转换转入业务的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年2月28日
7	关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年3月13日
8	关于公司法定名称变更的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年3月19日
9	关于增加东兴证券、国联证券、华安证券、九州证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年3月20日
10	关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年3月26日
11	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换业务的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年3月31日
12	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换业务的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年4月8日
13	关于增加中国建设银行为兴全合泰混合型证券投资基金C类份额销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年4月22日
14	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换业务的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年4月24日
15	关于调整旗下部分基金在招商银行最低定期定额投资金额的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年5月12日
16	关于增加江苏银行为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年5月18日
17	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年5月22日
18	关于变更直销中心银行账户信息的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年5月25日
19	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联网网站	2020年6月2日

20	关于增加中信证券华南为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 10 日
21	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换业务的公告	上海证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 17 日
22	关于增加国盛证券为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 19 日
23	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	上海证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 19 日
24	关于兴全合泰混合型证券投资基金暂停申购、赎回、转换业务的公告	上海证券报及规定 互联网网站	2020 年 6 月 24 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							
本基金本报告期未发生单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。							

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴全合泰混合型证券投资基金注册的批复
- 2、《兴全合泰混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全合泰混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 5、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 6、关于申请募集注册兴全合泰混合型证券投资基金的法律意见书
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日