

2020 年 12 月底公司旗下基金产品风险评价

根据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》中关于公司旗下基金产品风险评价的具体要求，以截止至 2020 年 12 月底各基金产品的相关指标为主要参照，进行基金产品的风险评价。

一、兴全可转债基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、国债，以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。

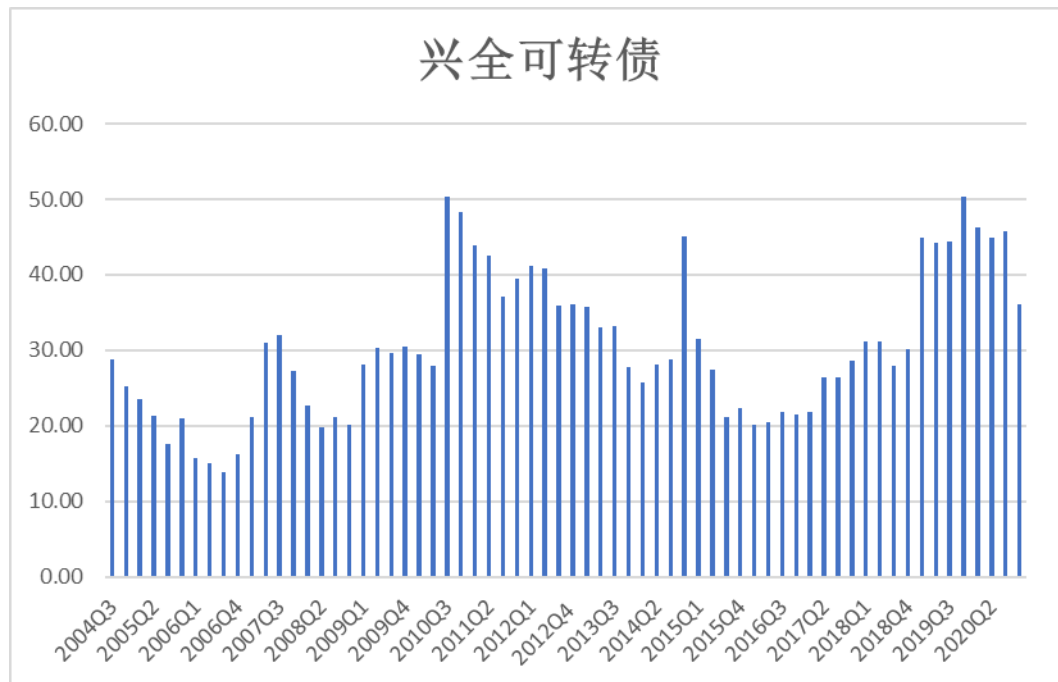
可转债 30%~95%（其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于 50%），股票不高于 30%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	873,581,690.98	24.06
	其中：股票	873,581,690.98	24.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,251,920,658.60	62.03
	其中：债券	2,251,920,658.60	62.03
	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	485,084,968.20	13.36
8	其他资产	19,815,953.25	0.55
9	合计	3,630,403,271.03	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全可转债	-3.93	-7.82%	-1.37	-2.96%	0.75	1.67%	-9.63	-21.06%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	5.40%	0.66%	4.02%	0.54%	1.38%	0.12%
过去六个月	16.45%	0.86%	9.44%	0.81%	7.01%	0.05%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二、兴全趋势投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益，增加投资组合收益的确定性和稳定性；充分分享中国上市公司高速成长带来的资本增值；减少决策的失误率，实现最优化的风险调整后的投资收益。

本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券（包括各种债券和货币市场工具）以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

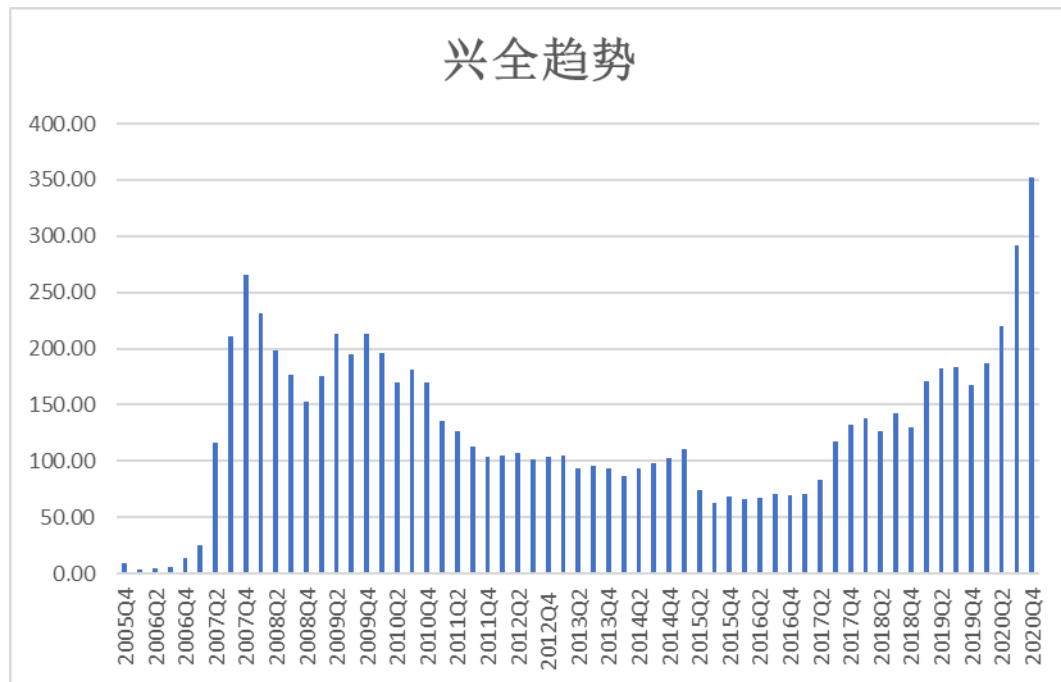
固定收益类证券的投资比重为 0—65%，股票的投资比重为 30%—95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	28,072,938,526.92	78.86
	其中：股票	28,072,938,526.92	78.86
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	7,284,501,883.96	20.46
8	其他资产	238,778,423.78	0.67
9	合计	35,596,218,834.66	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全趋势投资	19.39	11.57%	32.99	17.65%	71.54	32.53%	61.07	20.95%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	11.70%	0.93%	7.21%	0.49%	4.49%	0.44%
过去六个月	27.81%	1.25%	12.21%	0.66%	15.60%	0.59%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

三、兴全全球视野基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金以全球视野的角度，主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司，追求当期收益实现与长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。若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。

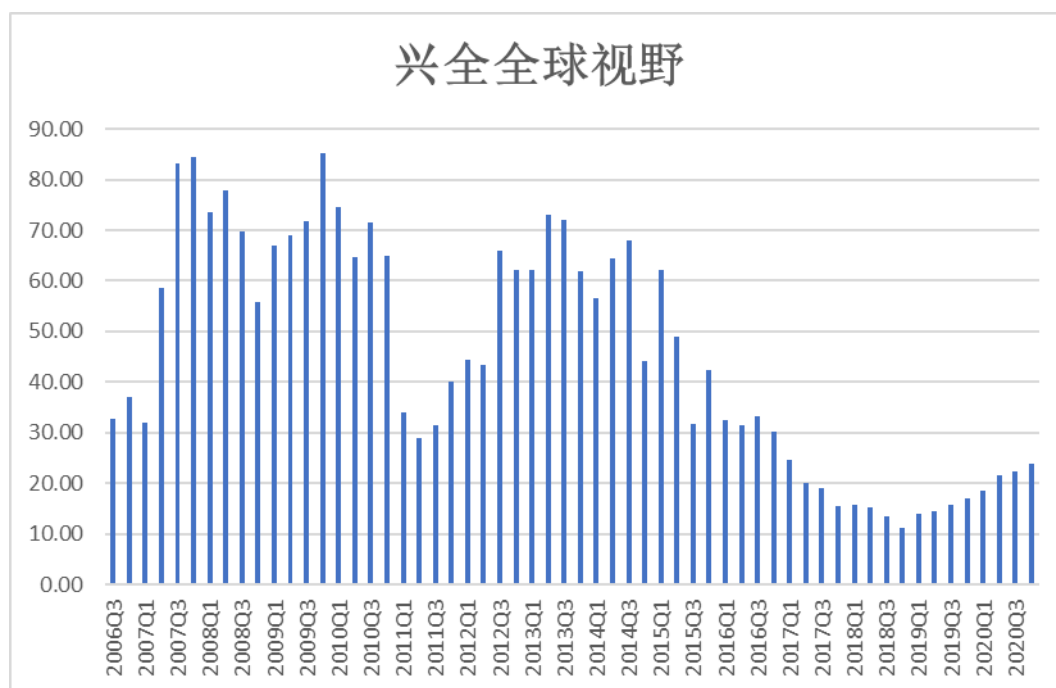
在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例为 80%-95%、债券投资比例为 0%-20%、权证投资比例为 0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,185,714,904.81	91.14
	其中：股票	2,185,714,904.81	91.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,811,283.35	5.08
	其中：债券	121,811,283.35	5.08
	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	53,198,411.38	2.22
8	其他资产	37,576,272.87	1.57
9	合计	2,398,300,872.41	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全全球视野	1.55	9.11%	3.21	17.30%	0.64	2.96%	1.44	6.46%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	9.84%	1.15%	10.99%	0.79%	-1.15%	0.36%
过去六个月	17.14%	1.42%	19.90%	1.08%	-2.76%	0.34%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

四、兴全社会责任基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值，同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。若法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人可在行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

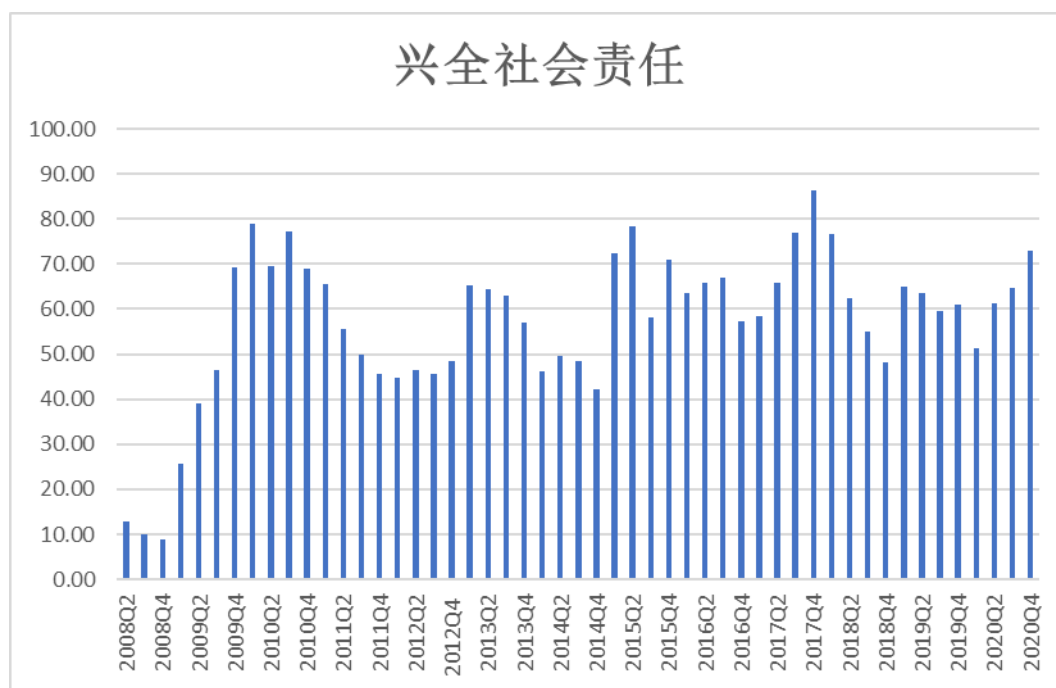
各类资产的投资比例为：股票投资比例为 65%-95%；债券投资比例为 0%-30%；资产支持证券占 0%-20%；权证投资比例 0%-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,832,164,676.85	92.74
	其中：股票	6,832,164,676.85	92.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,811,200.00	0.21
	其中：债券	15,811,200.00	0.21
	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	443,998,468.52	6.03
8	其他资产	75,321,511.26	1.02
9	合计	7,367,295,856.63	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全社会责任	-9.74	-15.98%	10.09	19.71%	3.42	5.57%	8.12	12.54%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	16.90%	1.32%	11.04%	0.79%	5.86%	0.53%
过去六个月	28.95%	1.58%	19.89%	1.07%	9.06%	0.51%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

五、兴全货币市场基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在力保本金安全性和基金资产良好流动性的基础上，使基金资产的变现损失降低至最低程度并有效地规避市场利率风险和再投资风险等，使基金收益达到同期货币市场的收益水平，力争超越业绩比较基准。

现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

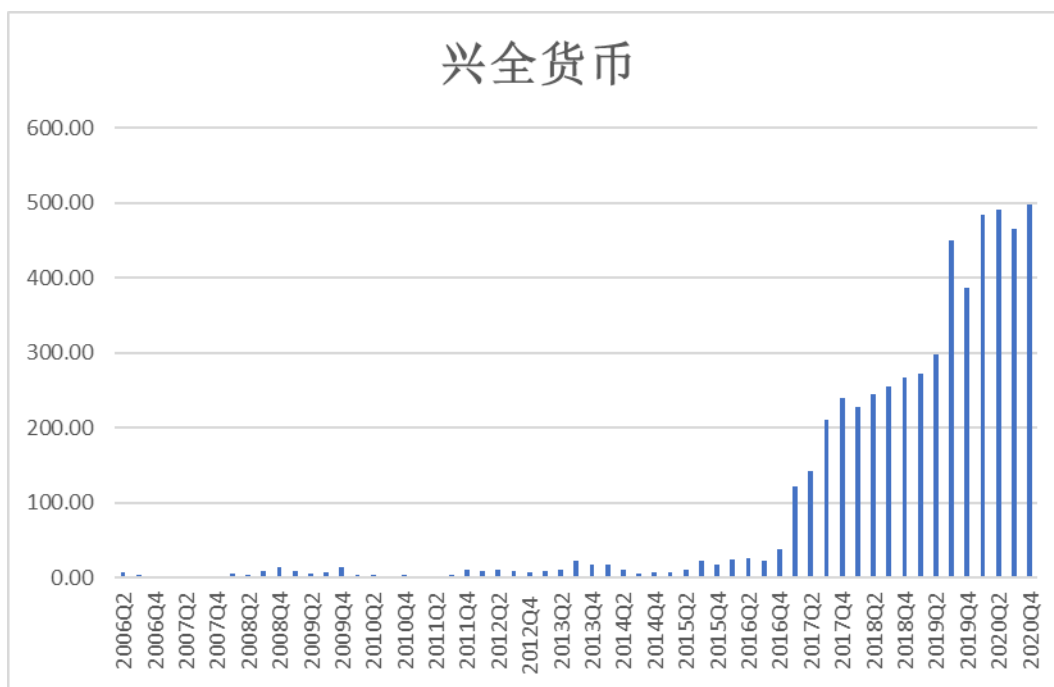
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	26,154,878,210.23	47.82
	其中：债券	26,154,878,210.23	47.82
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	10,958,186,837.25	20.03
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备 付金合计	16,225,124,060.51	29.66
4	其他资产	1,358,509,413.24	2.48
5	合计	54,696,698,521.23	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全货币	97.05	25.13%	8.09	1.67%	-25.82	-5.26%	31.22	6.71%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全货币 A 类份额:

阶段	净值增长率①	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	0.6357%	0.0011%	0.3277%	0.0000%	0.3080%	0.0011%
过去六个月	1.1472%	0.0012%	0.6553%	0.0000%	0.4919%	0.0012%

截止日期: 2020 年 12 月 31 日

兴全货币 B 类份额:

阶段	净值增	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	-----	------	------	------	-----	-----

	长率①	率 标准 差 ②	基 准 收 益 率③	基 准 收 益 率 标准 差 ④		
过去三个月	0.6962%	0.0011%	0.3277%	0.0000%	0.3685%	0.0011%
过去六个月	1.2692%	0.0012%	0.6553%	0.0000%	0.6139%	0.0012%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R1。

六、兴全有机增长混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金投资于有机增长能力强的公司，获取当前收益及实现长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 30%-80%；债券投资比例为基金资产的 0%-65%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资组合中突出有机增长特征的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%。

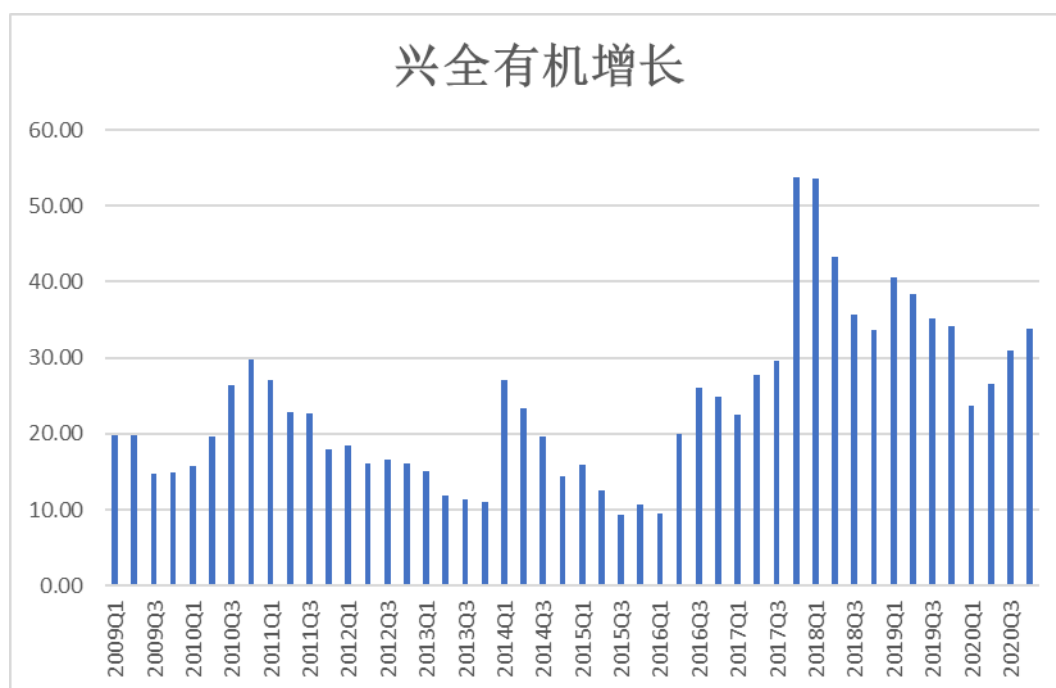
如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,683,013,922.20	78.30
	其中：股票	2,683,013,922.20	78.30
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	637,334,641.97	18.60
	其中：债券	637,334,641.97	18.60
	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	99,739,573.46	2.91
8	其他资产	6,315,172.45	0.18
9	合计	3,426,403,310.08	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全有机	-10.40	-30.45%	2.81	11.81%	4.33	16.29%	3.01	9.76%

增长								
----	--	--	--	--	--	--	--	--

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	14.19%	1.01%	7.21%	0.49%	6.98%	0.52%
过去六个月	29.27%	1.29%	12.21%	0.66%	17.06%	0.63%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

七、兴全磐稳增利债券型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在保证基金资产良好流动性的基础上，通过严格风险控制下的债券及其他证券产品投资，追求低风险下的稳定收益，并争取在基金资产保值的基础上，积极利用各种稳健的投资工具力争资产的持续增值。

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括依法公开发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、资产支持证券、同业存单以及中国证监会允许基金投资的其他债券类金融工具。

本基金不参与定向增发或网下新股申购，也不在二级市场直接买入股票、权证等权益类资产。本基金可以参与一级市场网上新股申购、公开增发，可以持有可转债转股所得股票及可分离债分离后所得权证，由上述方式获得的股票或权证将在可交易日起 5 个交易日内全部卖出。本基金可以主动投资于纯债收益率为正的可转债，不主动投资于纯债收益率为零或为负的可转债。

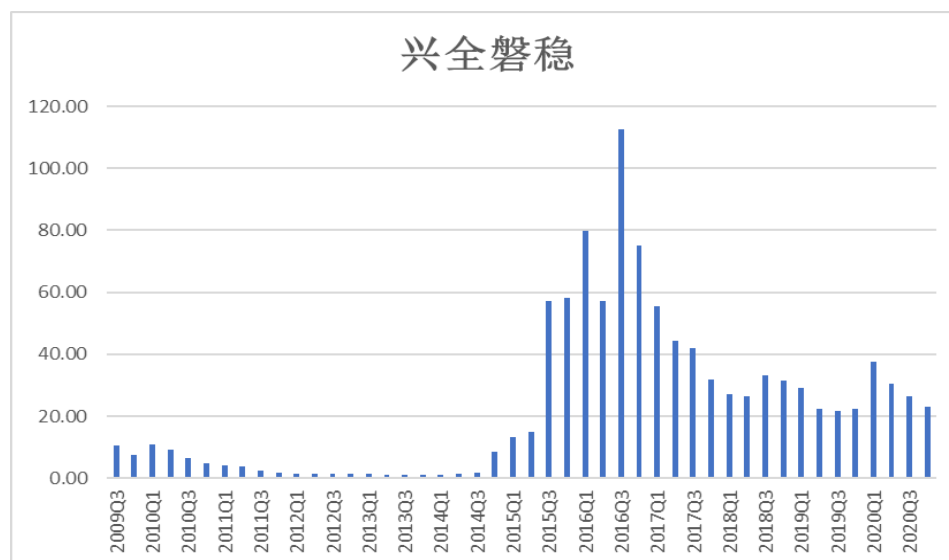
本基金各类资产的投资比例为：债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%，其中权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,670,874,528.11	92.96
	其中：债券	2,670,874,528.11	92.96
	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	45,800,677.25	1.59
8	其他资产	156,530,511.94	5.45
9	合计	2,873,205,717.30	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全磐稳增利债券	15.13	67.45%	-6.92	-18.43%	-4.26	-13.90%	-3.34	-12.67%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全磐稳债券 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	-0.39%	0.22%	1.24%	0.05%	-1.63%	0.17%
过去六个月	2.05%	0.28%	0.50%	0.07%	1.55%	0.21%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全磐稳债券 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	-0.50%	0.22%	1.24%	0.05%	-1.74%	0.17%
过去六个月	1.84%	0.28%	0.50%	0.07%	1.34%	0.21%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金

的风险等级：R2。

八、兴全合润混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金通过定量与定性相结合精选股票，以追求当期收益与实现长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

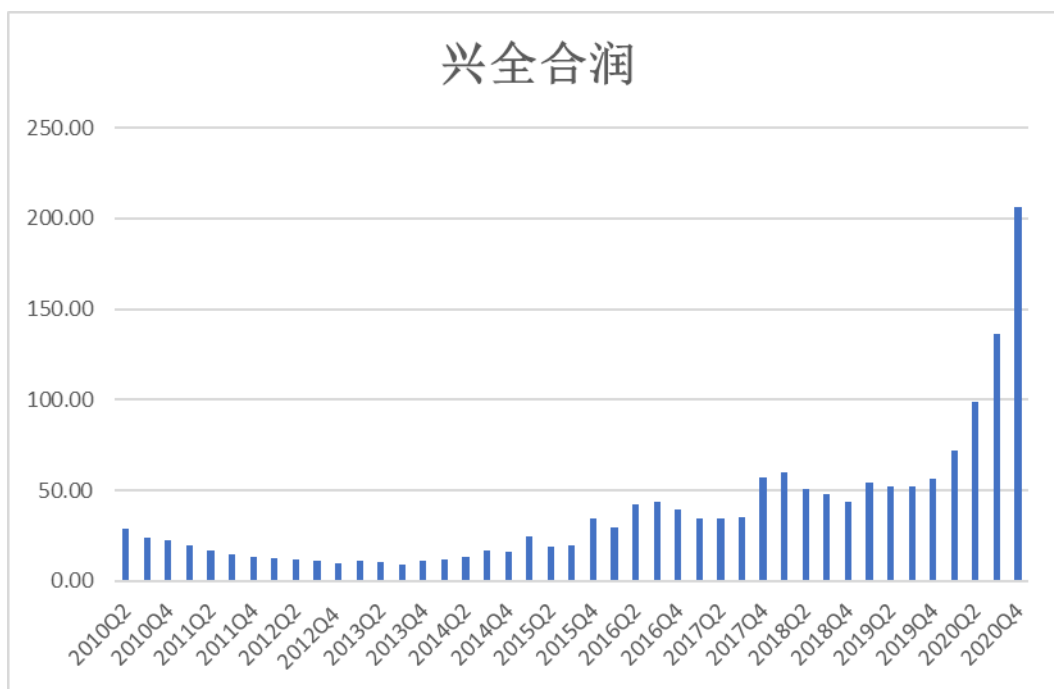
本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	17,908,374,749.44	86.21
	其中：股票	17,908,374,749.44	86.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,038,404,383.64	5.00
	其中：债券	1,038,404,383.64	5.00
	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	1,701,881,119.08	8.19
8	其他资产	124,668,451.73	0.60
9	合计	20,773,328,703.89	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全合润	15.85	28.25%	26.66	37.05%	37.44	37.97%	69.93	51.40%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	17.78%	1.12%	11.04%	0.79%	6.74%	0.33%
过去六个月	36.44%	1.37%	19.89%	1.07%	16.55%	0.30%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

此外，兴全合润分级混合型证券投资基金之合润 A 份额和合润 B 份额已于 2021 年 1 月 4 日终止上市（最后交易日为 2020 年 12 月 31 日），基金名称于 2021 年 1 月 1 日起变更为“兴全合润混合型证券投资基金”。

九、兴全沪深 300 指数增强型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

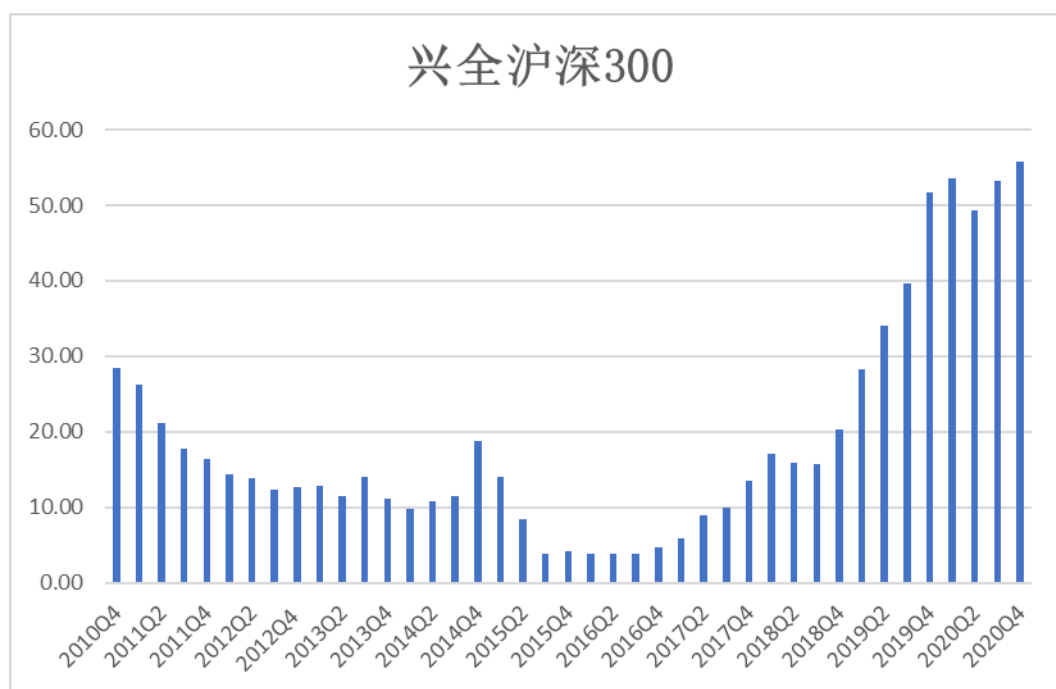
2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,352,995,578.31	90.66
	其中：股票	5,352,995,578.31	90.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	463,605,564.42	7.85
	其中：债券	463,605,564.42	7.85
	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	2,000,000.00	0.03
	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	11,827,072.99	0.20
8	其他资产	74,200,916.88	1.26
9	合计	5,904,629,132.60	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全沪深 300	1.83	3.55%	-4.26	-7.96%	3.92	7.96%	2.61	4.92%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全沪深 300 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	11.31%	0.93%	12.90%	0.94%	-1.59%	-0.01%
过去六个月	25.66%	1.33%	23.83%	1.28%	1.83%	0.05%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全沪深 300 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	11.19%	0.93%	12.90%	0.94%	-1.71%	-0.01%
过去六个月	25.41%	1.32%	23.83%	1.28%	1.58%	0.04%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

十、兴全绿色投资混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，力争实现当期投资收益与长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合绿色投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基

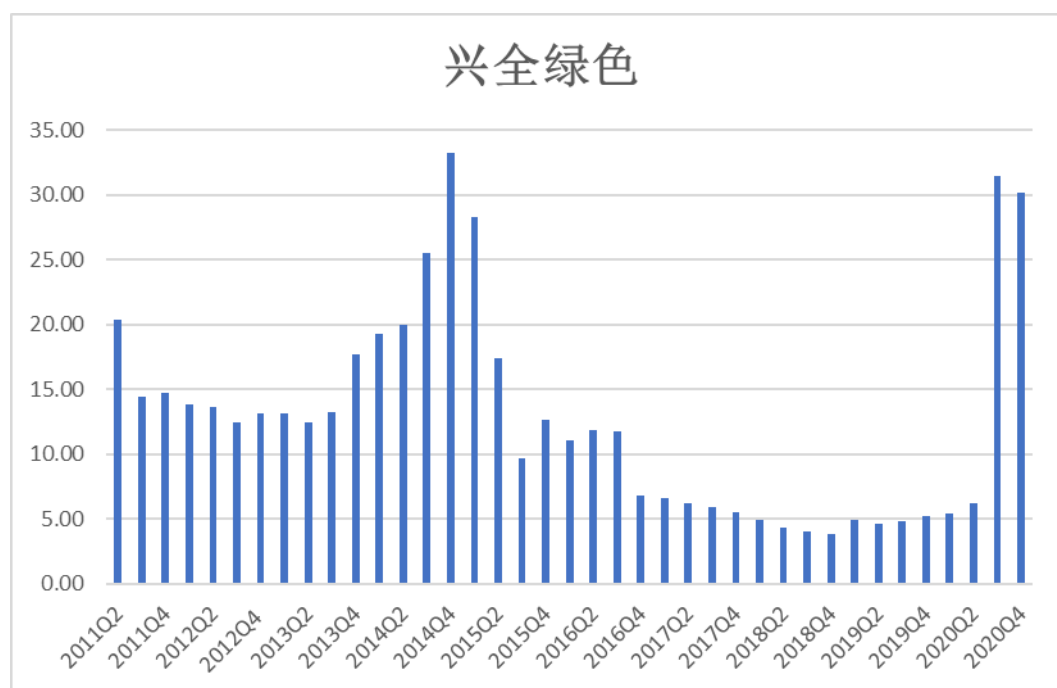
金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,836,665,070.92	91.96
	其中：股票	2,836,665,070.92	91.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	179,257,888.10	5.81
	其中：债券	179,257,888.10	5.81
	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	56,443,045.70	1.83
8	其他资产	12,393,274.13	0.40
9	合计	3,084,759,278.85	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全绿色投资	0.20	3.77%	0.80	14.87%	25.22	405.78%	-1.26	-4.02%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	13.04%	1.01%	12.60%	0.75%	0.44%	0.26%
过去六个月	29.07%	1.25%	22.70%	1.06%	6.37%	0.19%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

十一、兴全精选混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金投资于优秀公司或有潜力成为优秀公司的股票，力争获取当期收益及实现长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券等）、回购、资产支持证券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

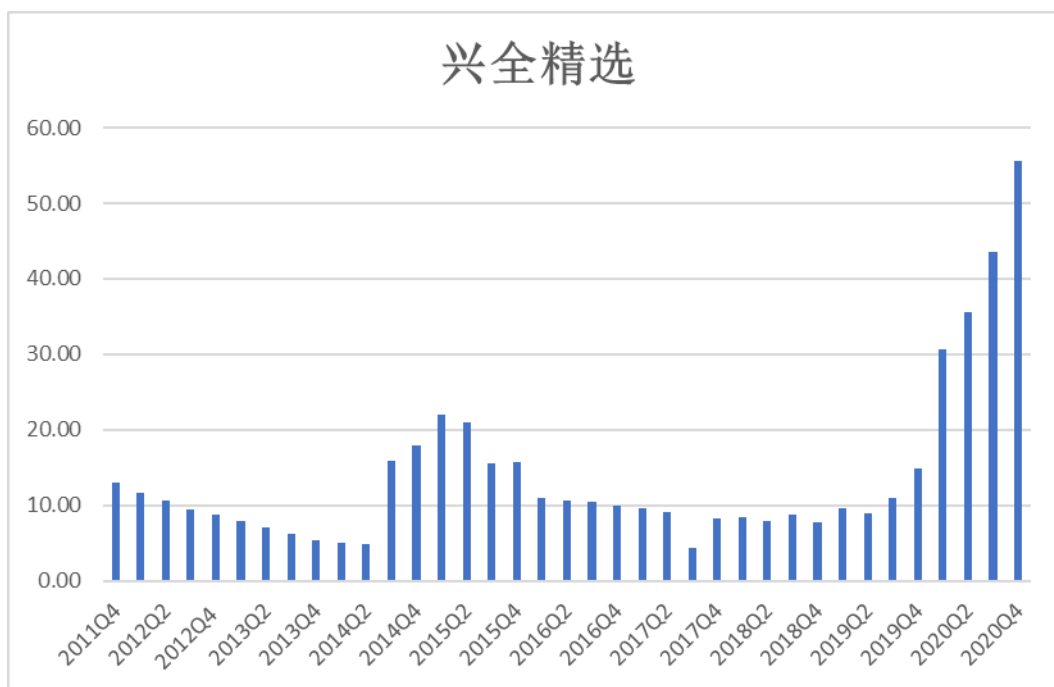
本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	4,967,405,249.66	88.00
	其中：股票	4,967,405,249.66	88.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	311,356,948.90	5.52
	其中：债券	311,356,948.90	5.52
	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	327,982,077.44	5.81
8	其他资产	38,235,477.60	0.68
9	合计	5,644,979,753.60	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全精选	15.76	106.02%	5.01	16.36%	7.89	22.14%	12.04	27.67%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	21.79%	1.42%	11.04%	0.79%	10.75%	0.63%
过去六个月	32.44%	1.68%	19.89%	1.07%	12.55%	0.61%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金

的风险等级：R3。

十二、兴全轻资产投资混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

以挖掘“轻资产公司”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

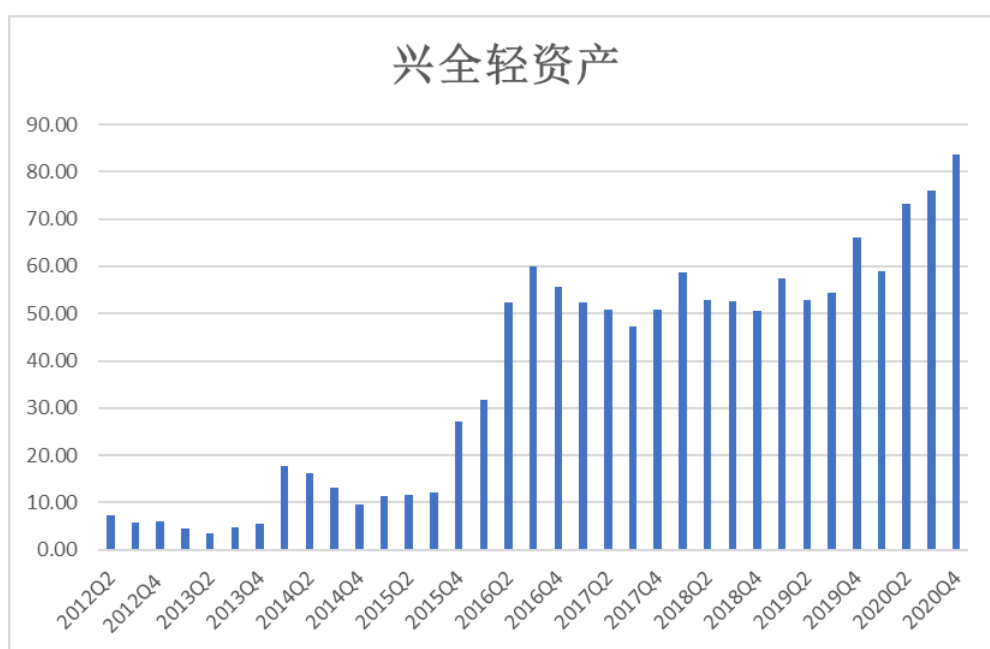
本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合轻资产投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,614,708,025.82	90.37
	其中：股票	7,614,708,025.82	90.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	299,690,000.00	3.56
	其中：债券	299,690,000.00	3.56
	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	495,531,704.17	5.88
8	其他资产	16,455,541.99	0.20
9	合计	8,426,385,271.98	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量(亿元)	变化率	变化量(亿元)	变化率
兴全轻资产	-7.23	-10.93%	14.36	24.37%	2.68	3.66%	7.67	10.10%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	12.53%	1.10%	11.04%	0.79%	1.49%	0.31%
过去六个月	21.84%	1.39%	19.89%	1.07%	1.95%	0.32%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

十三、兴全商业模式优选混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金以挖掘、筛选具有优秀商业模式的公司为主要投资策略，通过投资这类公司，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、银行存款（包括活期存款和定期存款）等货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合商业模式优选投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

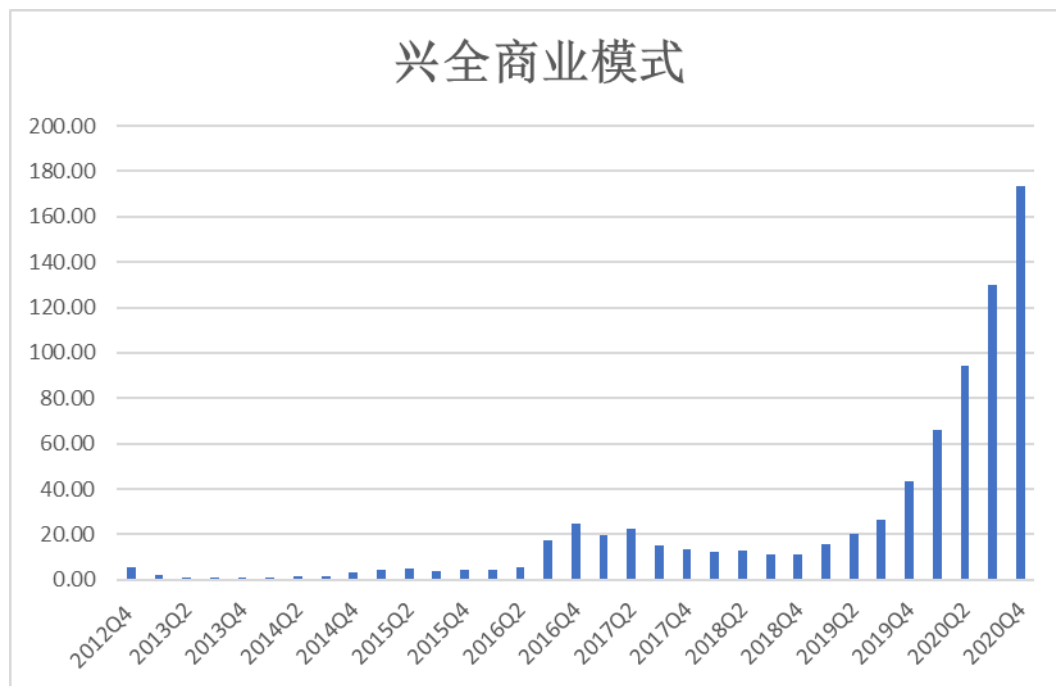
2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,862,139,146.41	89.84
	其中：股票	15,862,139,146.41	89.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	934,296,601.40	5.29
	其中：债券	934,296,601.40	5.29
	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	784,830,846.77	4.45
8	其他资产	74,438,317.88	0.42
9	合计	17,655,704,912.46	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全商业模式	22.36	51.55%	28.70	43.66%	35.26	37.34%	43.63	33.64%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	16.71%	1.09%	11.04%	0.79%	5.67%	0.30%

过去六个月	35.43%	1.40%	19.89%	1.07%	15.54%	0.33%
-------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

十四、兴全添利宝货币市场基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

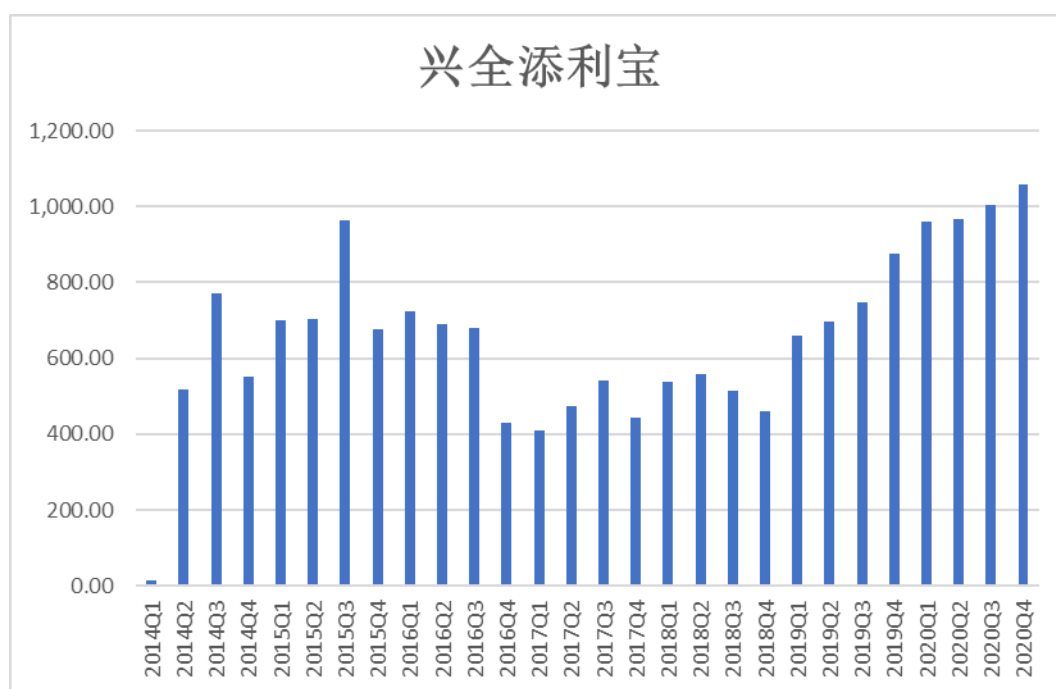
本基金投资于现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款（包括活期存款、定期存款、通知存款等）、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在397天以内（含 397 天）的债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	53,261,078,866.08	46.56
	其中：债券	53,261,078,866.08	46.56
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	29,622,291,806.61	25.90
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备 付金合计	31,038,830,981.44	27.13
4	其他资产	469,685,730.20	0.41
5	合计	114,391,887,384.33	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全添利宝	84.05	9.61%	6.98	0.73%	39.51	4.09%	53.36	5.31%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	0.6058%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.2655%	0.0005%
过去六个月	1.0979%	0.0009%	0.6805%	0.0000%	0.4174%	0.0009%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R1。

十五、兴全新视野混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金通过精选基本面良好，具有盈利能力和市场竞争力的公司，同时通过灵活应用多种绝对收益策略，寻求基金资产的长期稳健增值。

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、债券等金融工具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。具体包括：股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），股指期货、权证，债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票投资比例为基金资产净值的 0%-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；开放期内的每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内，本基金不受 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指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。

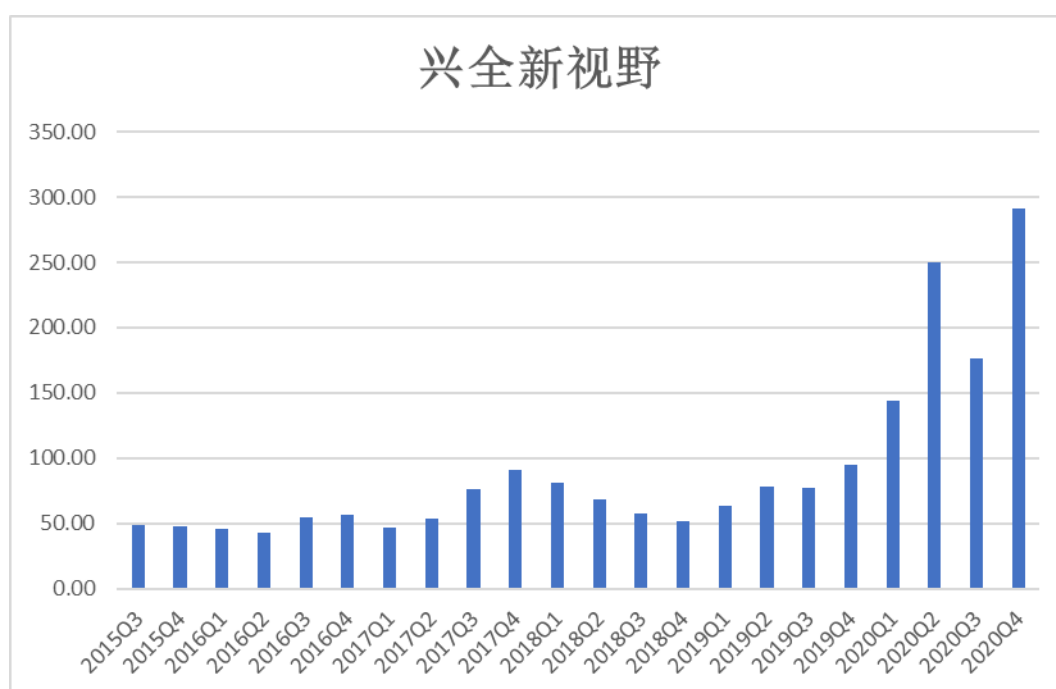
2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	20,204,385,754.98	69.37
	其中：股票	20,204,385,754.98	69.37
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	204,269,927.00	0.70
	其中：债券	204,269,927.00	0.70
	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	8,621,252,887.25	29.60
8	其他资产	96,713,710.69	0.33
9	合计	29,126,622,279.92	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全新视野	49.10	51.58%	105.34	73.00%	-73.25	-29.34%	114.55	64.94%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	8.96%	0.81%	1.16%	0.02%	7.80%	0.79%
过去六个月	19.90%	1.26%	2.35%	0.01%	17.55%	1.25%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

十六、兴全稳益定期开放债券型发起式基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，积极利用各种稳健的固定收益类投资工具实现基金资产长期、稳定的投资回报。

本基金的投资范围包括国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等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)。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。

本基金在开放期持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金在封闭期内不受前述 5%的比例限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

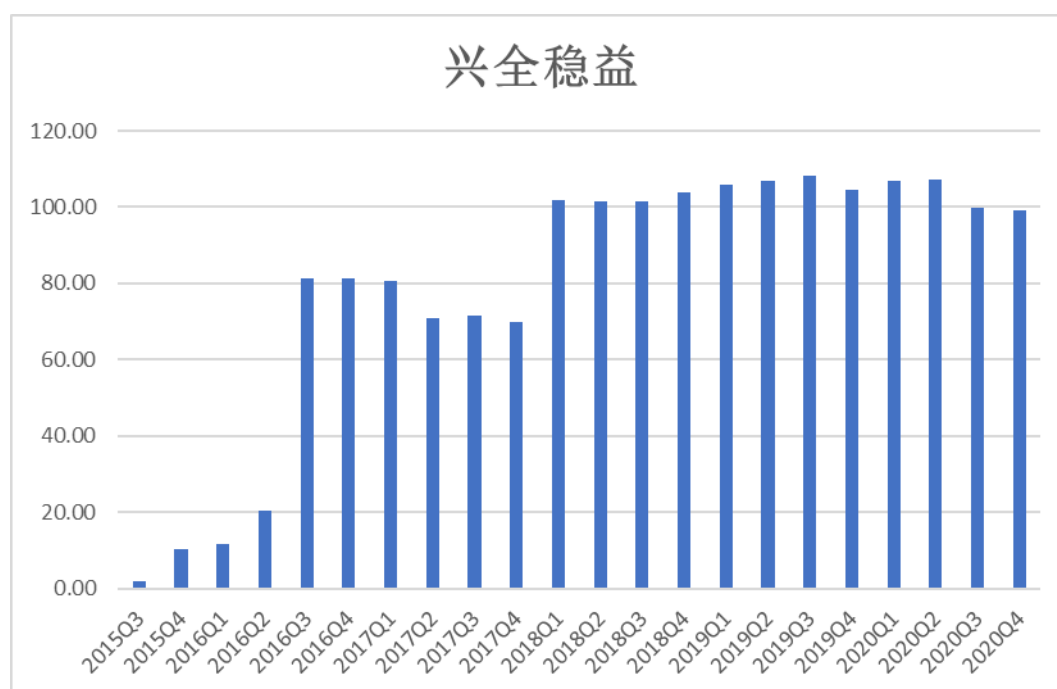
如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,948,820,270.00	97.76
	其中：债券	10,948,820,270.00	97.76
	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	48,808,090.61	0.44
8	其他资产	201,913,448.57	1.80
9	合计	11,199,541,809.18	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全稳益	2.30	2.19%	0.44	0.41%	-7.68	-7.15%	-0.41	-0.41%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	0.59%	0.05%	1.31%	0.05%	-0.72%	0.00%
过去六个月	1.15%	0.05%	0.52%	0.07%	0.63%	-0.02%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

十七、兴全天添益货币市场基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金的投资目标是在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

本基金投资于以下金融工具：现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在

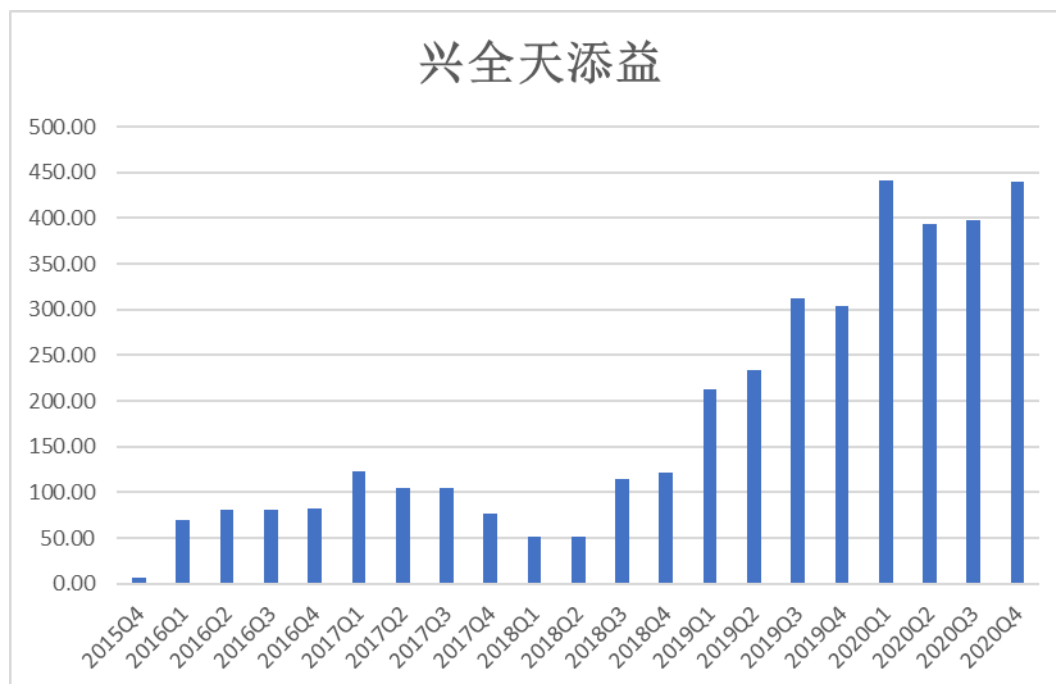
履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	24,309,159,101.93	51.54
	其中：债券	24,309,159,101.93	51.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	13,069,104,003.64	27.71
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	9,614,122,441.77	20.38
4	其他资产	171,821,560.02	0.36
5	合计	47,164,207,107.36	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率

兴全天添益	137.47	45.33%	-46.81	-10.62%	4.49	1.14%	41.47	10.41%
-------	--------	--------	--------	---------	------	-------	-------	--------

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全天添益 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	0.6616%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.3213%	0.0008%
过去六个月	1.1914%	0.0012%	0.6805%	0.0000%	0.5109%	0.0012%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全天添益 B 类份额：

阶段	净值增长率①	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	0.7018%	0.0008%	0.3403%	0.0000%	0.3615%	0.0008%
过去六个月	1.2722%	0.0012%	0.6805%	0.0000%	0.5917%	0.0012%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R1。

十八、兴全稳泰债券型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金的投资目标是在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下,追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等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的相关规定)。

本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%;本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

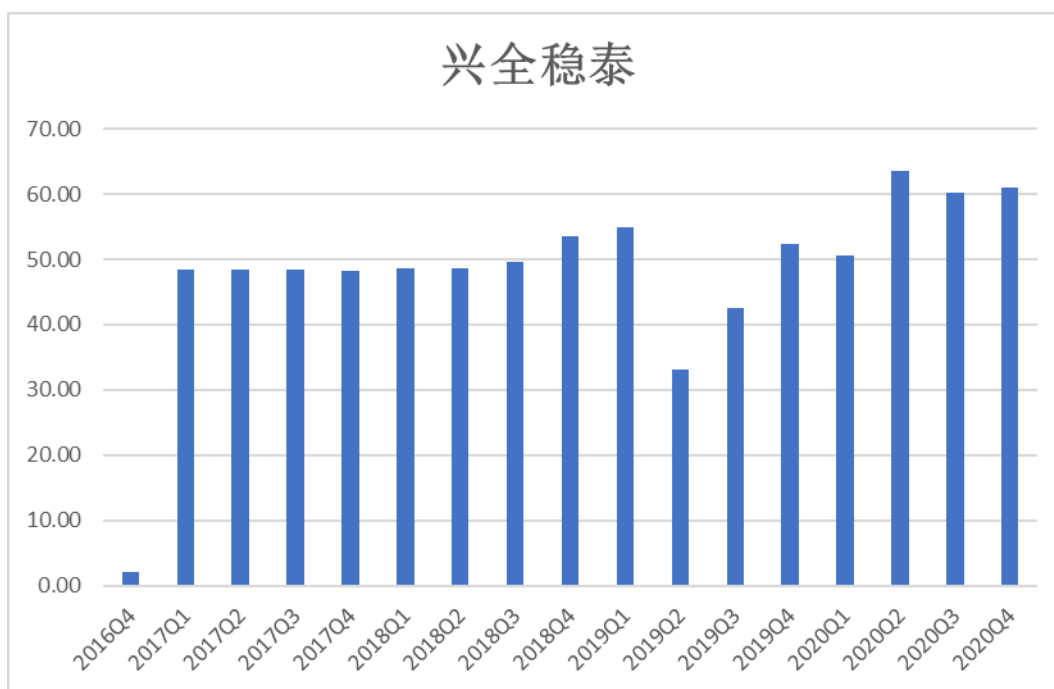
如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,960,013,478.00	97.82
	其中:债券	7,960,013,478.00	97.82
	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	18,436,383.32	0.23
8	其他资产	159,089,889.01	1.96
9	合计	8,137,539,750.33	100.00

3、本基金历史规模

单位:亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全稳泰	-1.85	-3.54%	12.95	25.60%	-3.25	-5.11%	0.68	1.12%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全稳泰 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	1.06%	0.04%	1.31%	0.05%	-0.25%	-0.01%
过去六个月	1.33%	0.06%	0.52%	0.07%	0.81%	-0.01%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全稳泰 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	1.02%	0.04%	1.31%	0.05%	-0.29%	-0.01%
过去六个月	1.23%	0.06%	0.52%	0.07%	0.71%	-0.01%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

十九、兴全兴泰定期开放债券型发起式基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金的投资目标是在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具等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的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但每个开放期的前 10 个工作日和后 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。

本基金在开放期持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，本基金在封闭期内持有现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例

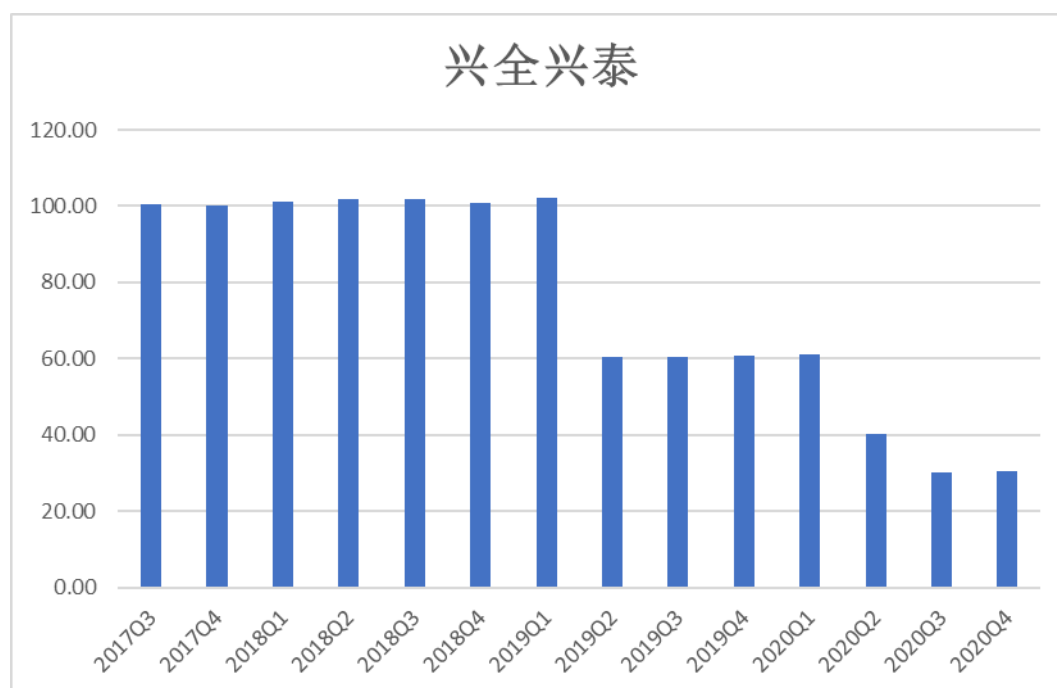
不受上述限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,294,977,940.00	97.88
	其中：债券	4,294,977,940.00	97.88
	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	31,254,244.39	0.71
8	其他资产	61,673,869.78	1.41
9	合计	4,387,906,054.17	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全兴泰	0.56	0.92%	-21.07	-34.42%	-9.98	-24.86%	0.27	0.88%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	0.88%	0.04%	1.31%	0.05%	-0.43%	-0.01%
过去六个月	1.18%	0.05%	0.52%	0.07%	0.66%	-0.02%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

二十、兴全恒益债券型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金的投资目标是在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债（含可分离交易可转债）、非公开发行公司债（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、政府支持机构债券、可交换债券、债券回购、银行存款（包括协议存

款、定期存款及其他银行存款)、同业单、货币市场工具等金融工具，国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、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的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

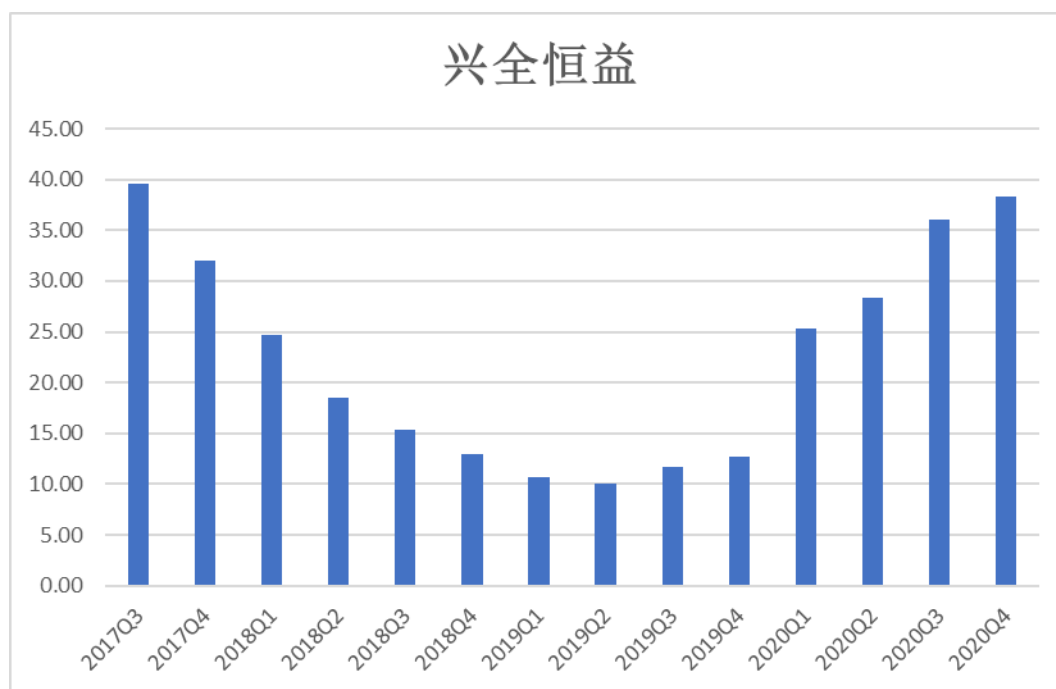
本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	876,297,074.16	18.22
	其中：股票	876,297,074.16	18.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,783,559,115.82	78.67
	其中：债券	3,783,559,115.82	78.67
	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	55,238,141.75	1.15
8	其他资产	94,290,190.82	1.96
9	合计	4,809,384,522.55	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全恒益	12.58	98.82%	2.97	11.74%	7.70	27.21%	2.30	6.39%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全恒益 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	0.35%	0.41%	3.48%	0.20%	-3.13%	0.21%
过去六个月	6.75%	0.63%	3.96%	0.25%	2.79%	0.38%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全恒益 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	0.25%	0.41%	3.48%	0.20%	-3.23%	0.21%
过去六个月	6.54%	0.63%	3.96%	0.25%	2.58%	0.38%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二十一、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具等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的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但每个开放期的前 10 个工作日、后 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。

开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或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

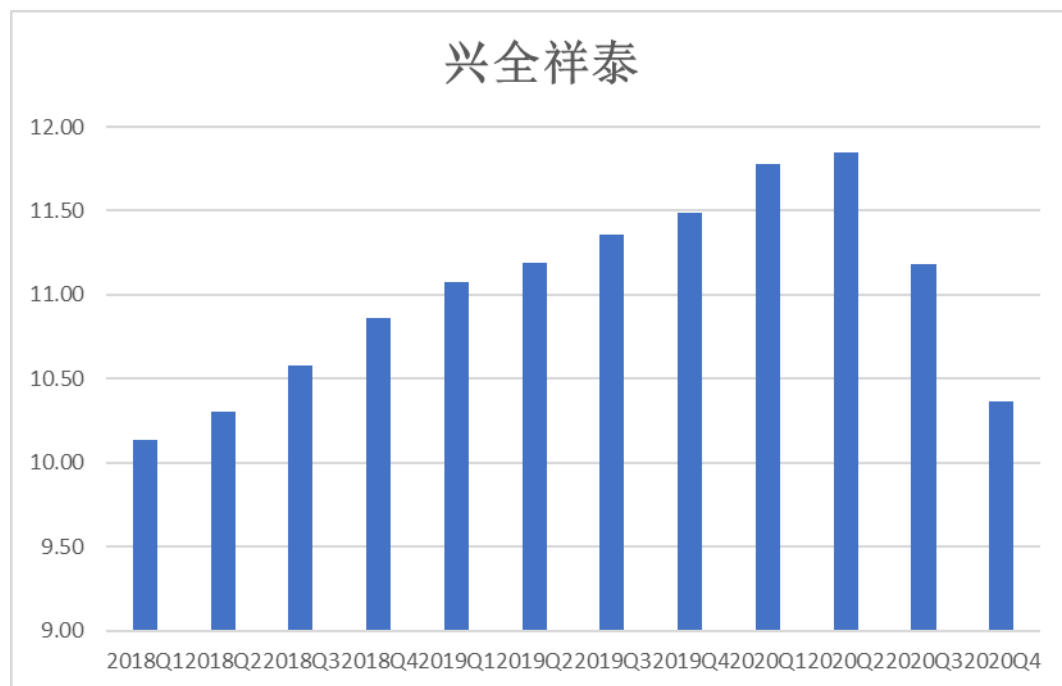
当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,406,259,400.00	97.99
	其中：债券	1,406,259,400.00	97.99
	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	6,366,713.17	0.44
8	其他资产	22,439,840.56	1.56
9	合计	1,435,065,953.73	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度	2020 年二季度	2020 年三季度	2020 年四季度
------	-----------	-----------	-----------	-----------

	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全祥泰	0.29	2.51%	0.07	0.57%	-0.66	-5.57%	-0.82	-7.31%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	0.67%	0.05%	1.31%	0.05%	-0.64%	0.00%
过去六个月	1.07%	0.05%	0.52%	0.07%	0.55%	-0.02%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

二十二、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

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。

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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

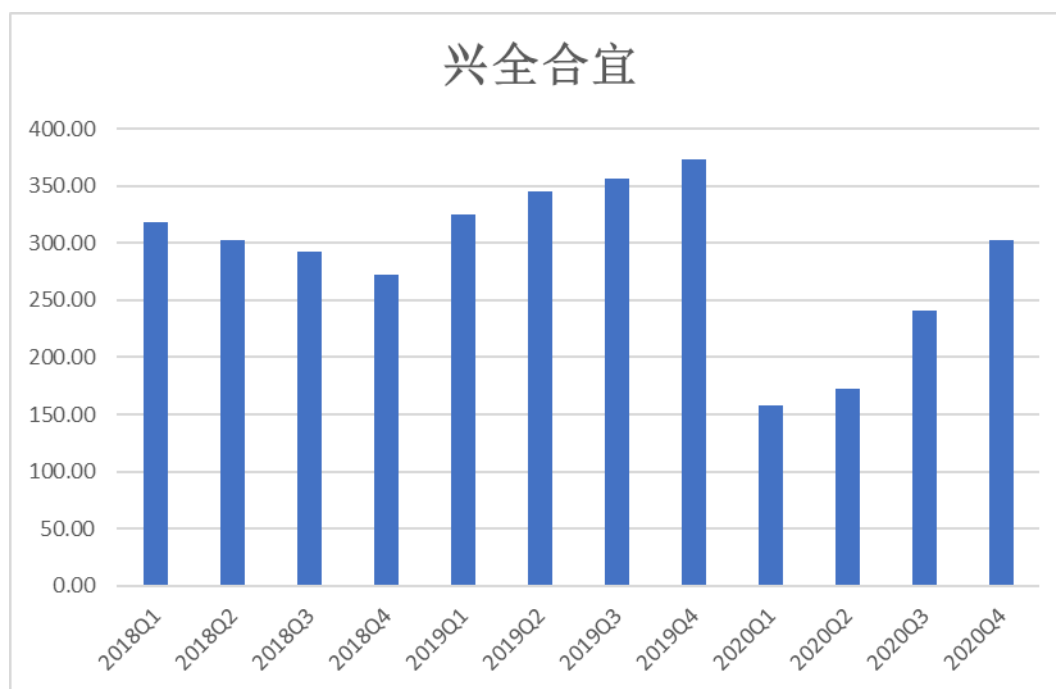
本基金封闭期届满转换为开放式基金后,每个交易日日终,股票资产投资比例为基金资产的 0%—95% (其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%),封闭期内每个交易日日终,股票资产投资比例为基金资产的 0%—100% (其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-100%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%); 权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%; 本基金封闭期届满转换为开放式基金后,每个交易日日终,在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比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。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	26,984,517,930.06	87.88
	其中:股票	26,984,517,930.06	87.88
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	36,693,214.00	0.12
	其中:债券	36,693,214.00	0.12
	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	3,648,152,151.14	11.88
8	其他资产	37,189,169.62	0.12
9	合计	30,706,552,464.82	100.00

3、本基金历史规模

单位:亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全合宜	-214.37	-57.54%	13.69	8.65%	69.01	40.15%	61.87	25.68%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全合宜 A 类份额:

阶段	净值增长率①	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	15.98%	1.26%	11.54%	0.71%	4.44%	0.55%
过去六个月	37.44%	1.47%	17.03%	0.94%	20.41%	0.53%

截止日期: 2020 年 12 月 31 日

兴全合宜 C 类份额:

阶段	净值增长率①	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	15.82%	1.26%	11.54%	0.71%	4.28%	0.55%
过去六个月	37.05%	1.47%	17.03%	0.94%	20.02%	0.53%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二十三、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。

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

调整投资范围。

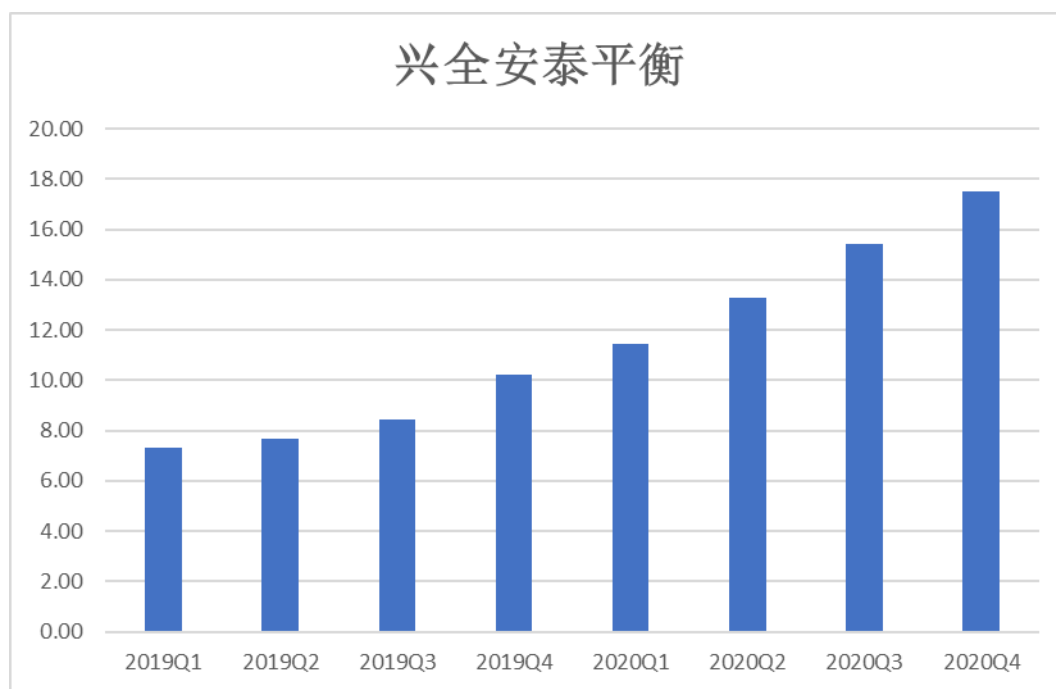
本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%；本基金的权益类资产投资比例中枢为 50%，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 40%-55%。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 50%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 50%的混合型基金。同时，股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 60%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	155,214,726.03	8.86
	其中：股票	155,214,726.03	8.86
2	基金投资	1,435,431,439.67	81.92
3	固定收益投资	112,464,886.98	6.42
	其中：债券	112,464,886.98	6.42
	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	32,572,365.50	1.86
8	其他资产	16,611,189.51	0.95
9	合计	1,752,294,607.69	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全安泰平衡	1.22	11.96%	1.86	16.27%	2.15	16.15%	2.09	13.54%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	6.92%	0.46%	7.66%	0.56%	-0.74%	-0.10%
过去六个月	16.47%	0.59%	12.10%	0.68%	4.37%	-0.09%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二十四、兴全恒裕债券型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货等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的相关规定）。本基金不直接从二级市场买入股票或权证等权益类资产，也不参与一级市场新股的申购或增发。因持有可转换债券转股所得的股票以及因所持股票派发的权证，应当在其可上市交易后的10个交易日内卖出。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或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。

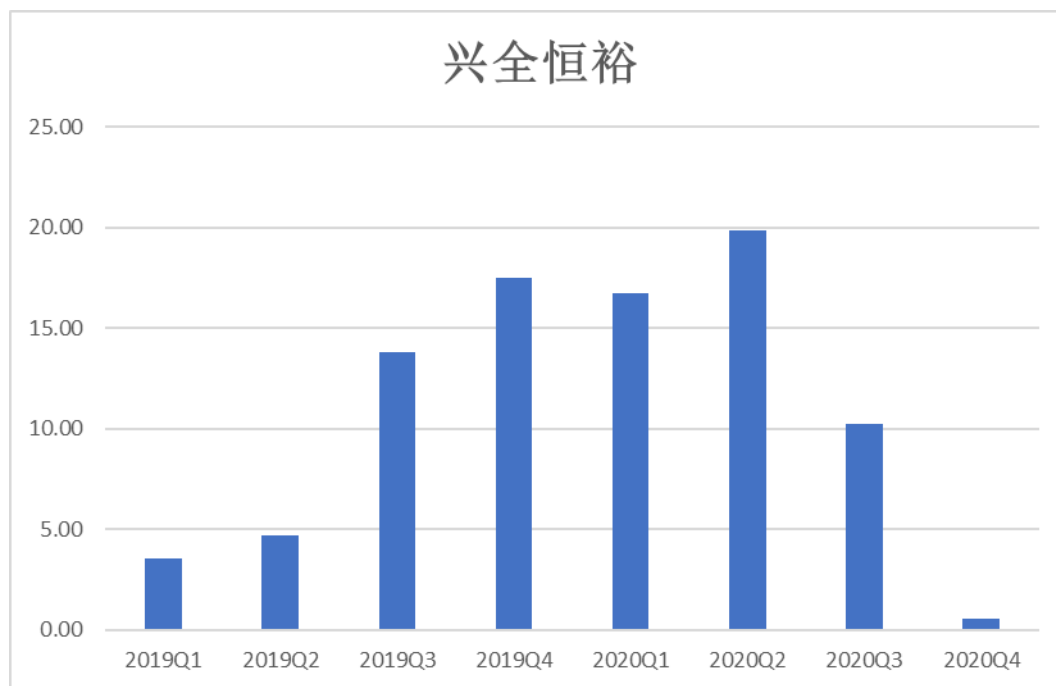
2、2020年12月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	51,712,378.00	97.00
	其中：债券	51,712,378.00	97.00
	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	—	—

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	655,959.78	1.23
8	其他资产	942,135.79	1.77
9	合计	53,310,473.57	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全恒裕	-0.76	-4.33%	3.11	18.61%	-9.60	-48.35%	-9.72	-94.82%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	0.97%	0.05%	1.31%	0.05%	-0.34%	0.00%

过去六个月	0.37%	0.08%	0.52%	0.07%	-0.15%	0.01%
-------	-------	-------	-------	-------	--------	-------

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

二十五、兴全多维价值混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。

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。

股票资产投资比例为基金资产的 60%—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。

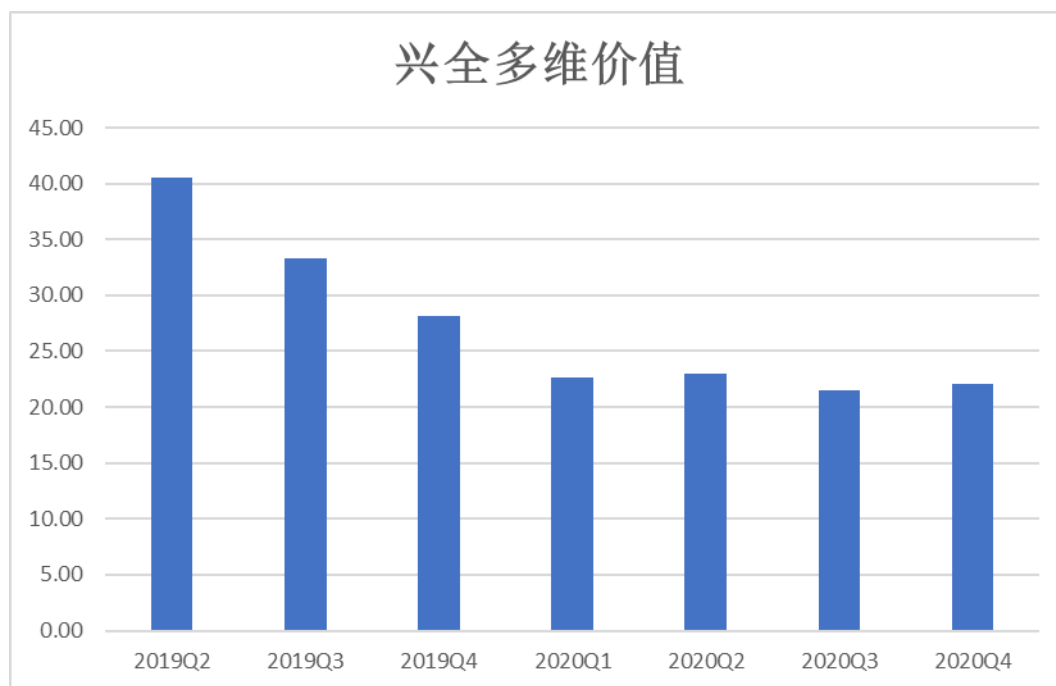
2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,011,670,369.49	88.56
	其中：股票	2,011,670,369.49	88.56

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,758,000.00	3.51
	其中：债券	79,758,000.00	3.51
	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	172,804,878.10	7.61
8	其他资产	7,385,333.09	0.33
9	合计	2,271,618,580.68	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全多维价值	-5.58	-19.80%	0.33	1.48%	-1.44	-6.27%	0.54	2.53%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全多维价值 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	13.73%	1.12%	10.50%	0.70%	3.23%	0.42%
过去六个月	25.10%	1.36%	15.16%	0.94%	9.94%	0.42%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全多维价值 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	13.55%	1.12%	10.50%	0.70%	3.05%	0.42%
过去六个月	24.72%	1.36%	15.16%	0.94%	9.56%	0.42%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二十六、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、次级债、

可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具等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的相关规定）。本基金不投资于股票、权证，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

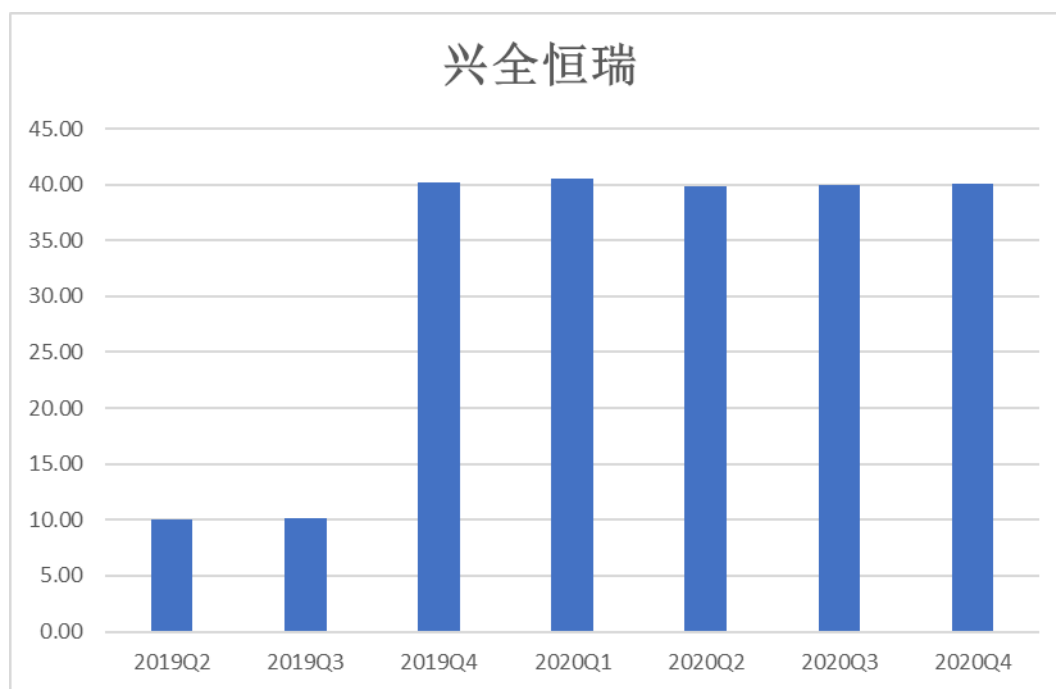
本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但每个开放期的前 10 个工作日、后 10 个工作日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,660,464,700.00	98.30
	其中：债券	5,660,464,700.00	98.30
	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	23,759,716.40	0.41
8	其他资产	74,035,627.57	1.29
9	合计	5,758,260,043.97	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全恒瑞	0.35	0.87%	-0.68	-1.69%	0.10	0.26%	0.15	0.37%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	0.86%	0.04%	1.31%	0.05%	-0.45%	-0.01%
过去六个月	1.12%	0.05%	0.52%	0.07%	0.60%	-0.02%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

二十七、兴全合泰混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

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。

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和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

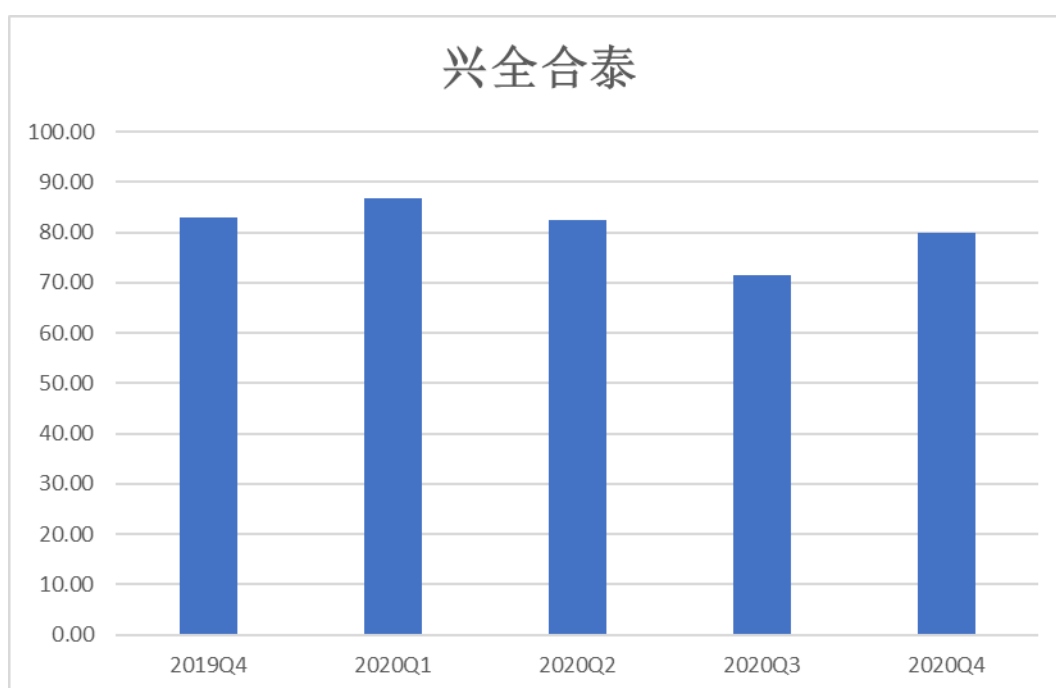
2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,438,582,597.67	92.13
	其中：股票	7,438,582,597.67	92.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	351,625,000.00	4.36
	其中：债券	351,625,000.00	4.36

	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	198,918,460.82	2.46
8	其他资产	84,453,819.42	1.05
9	合计	8,073,579,877.91	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全合泰	3.96	4.78%	-4.39	-5.05%	-11.06	-13.42%	8.62	12.08%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全合泰 A 类份额：

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	19.93%	1.22%	10.50%	0.70%	9.43%	0.52%
过去六个月	37.80%	1.51%	15.16%	0.94%	22.64%	0.57%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全合泰 C 类份额：

阶段	净值增长 率①	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	19.75%	1.22%	10.50%	0.70%	9.25%	0.52%
过去六个月	37.38%	1.51%	15.16%	0.94%	22.22%	0.57%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二十八、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

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。

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、科创板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、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 60%—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期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

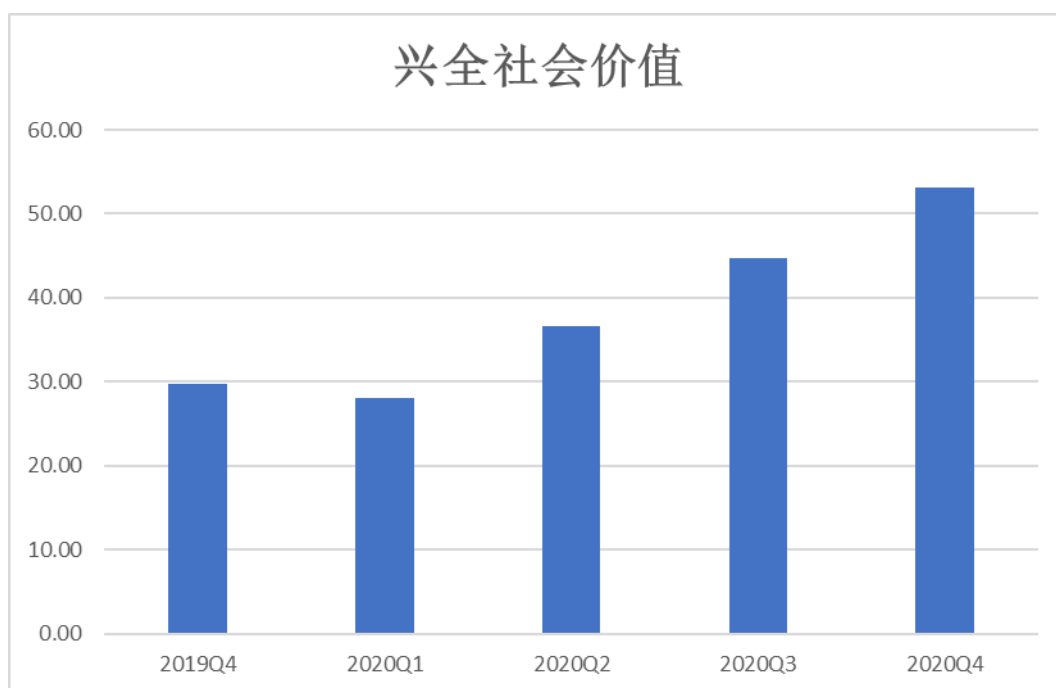
如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,692,259,673.15	87.50
	其中:股票	4,692,259,673.15	87.50
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	20,986,726.10	0.39
	其中:债券	20,986,726.10	0.39
	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	647,902,257.83	12.08
8	其他资产	1,484,500.83	0.03
9	合计	5,362,633,157.91	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年一季度		2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全社会价值	-1.62	-5.45%	8.60	30.63%	8.01	21.85%	8.39	18.77%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	18.77%	1.28%	10.50%	0.70%	8.27%	0.58%
过去六个月	44.73%	1.49%	15.16%	0.94%	29.57%	0.55%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

二十九、兴全恒鑫债券型证券投资基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货等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的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票等权益类资产，但可持有因可转债转股所形成的股票等。因上述原因持有的股票等资产，本基金应在其可交易之日起的30个交易日内卖出。

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，且信用债的投资比例为基金资产的50%-95%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

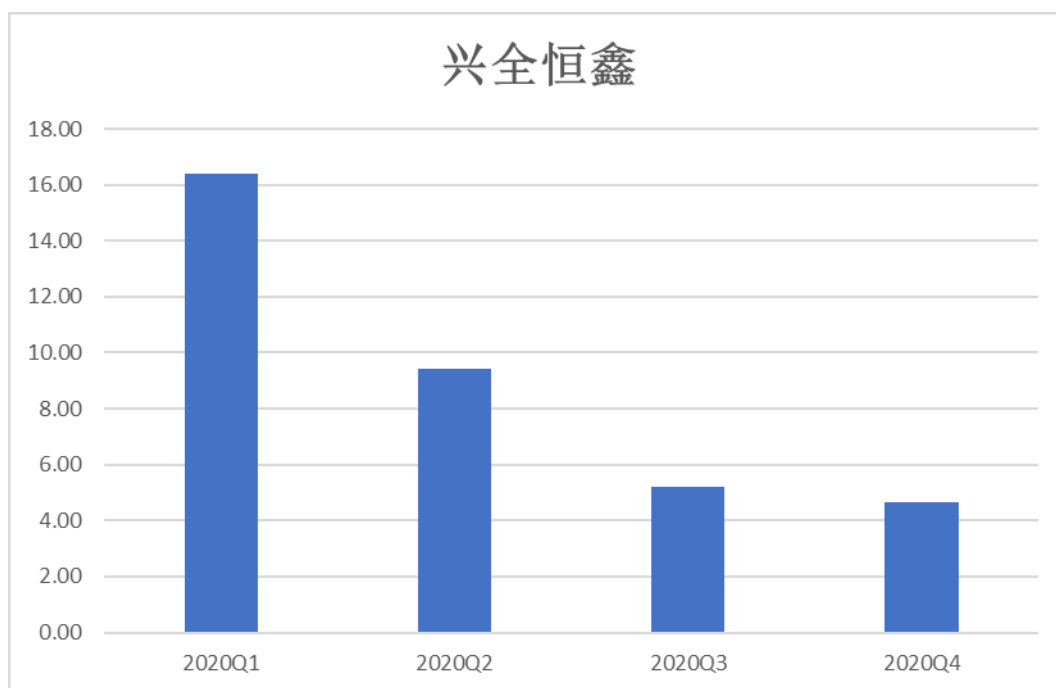
2、2020年12月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,089,083.18	4.18
	其中：股票	22,089,083.18	4.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	446,269,632.49	84.37
	其中：债券	446,269,632.49	84.37
	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	17,000,000.00	3.21
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	36,877,660.93	6.97
8	其他资产	6,702,874.58	1.27
9	合计	528,939,251.18	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全恒鑫	-6.96	-42.45%	-4.24	-44.96%	-0.53	-10.23%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全恒鑫 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	7.44%	0.39%	-0.14%	0.04%	7.58%	0.35%
过去六个月	10.90%	0.38%	-1.16%	0.05%	12.06%	0.33%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全恒鑫 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	7.33%	0.39%	-0.14%	0.04%	7.47%	0.35%
过去六个月	10.67%	0.38%	-1.16%	0.05%	11.83%	0.33%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

三十、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在控制风险的前提下，通过优选基金积极把握基金市场的投资机会，力求基金资产的长期稳健增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存

款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金等权益类资产投资合计占基金资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占基金资产的比例不高于 15%。本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

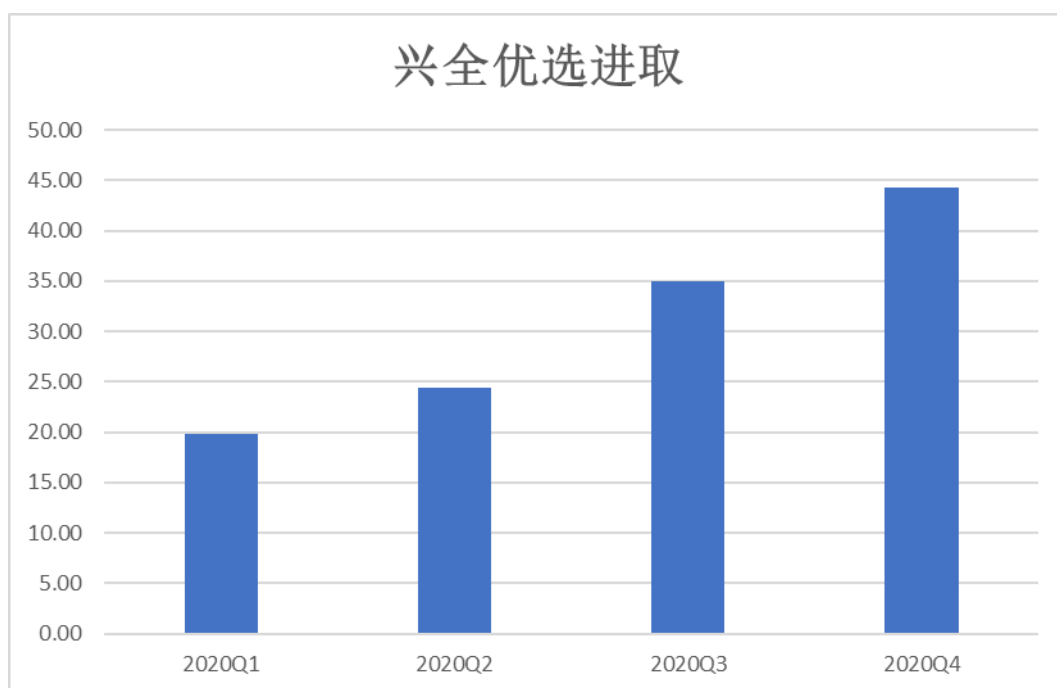
- 1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 50%的混合型基金；
- 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 50%的混合型基金。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	259,116,831.72	5.79
	其中：股票	259,116,831.72	5.79
2	基金投资	3,745,788,856.73	83.73
3	固定收益投资	289,084,942.70	6.46
	其中：债券	289,084,942.70	6.46
	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	105,561,013.33	2.36
8	其他资产	74,059,153.83	1.66
9	合计	4,473,610,798.31	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年二季度		2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量(亿 元)	变化率	变化量(亿 元)	变化率
兴全优选进取	4.63	23.38%	10.54	43.18%	9.29	26.59%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	10.31%	0.74%	12.00%	0.90%	-1.69%	-0.16%
过去六个月	23.93%	0.96%	20.30%	1.10%	3.63%	-0.14%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

三十一、兴全沪港深两年持有期混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金通过对沪深港三地证券市场中资本动向的追踪研究，在有效控制投资组合风险的前提下，力求实现资产净值的长期稳健增值。

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或注册发行的股票）、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其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的股票资产投资比例为基金资产的60%—95%，其中，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的80%；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，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。

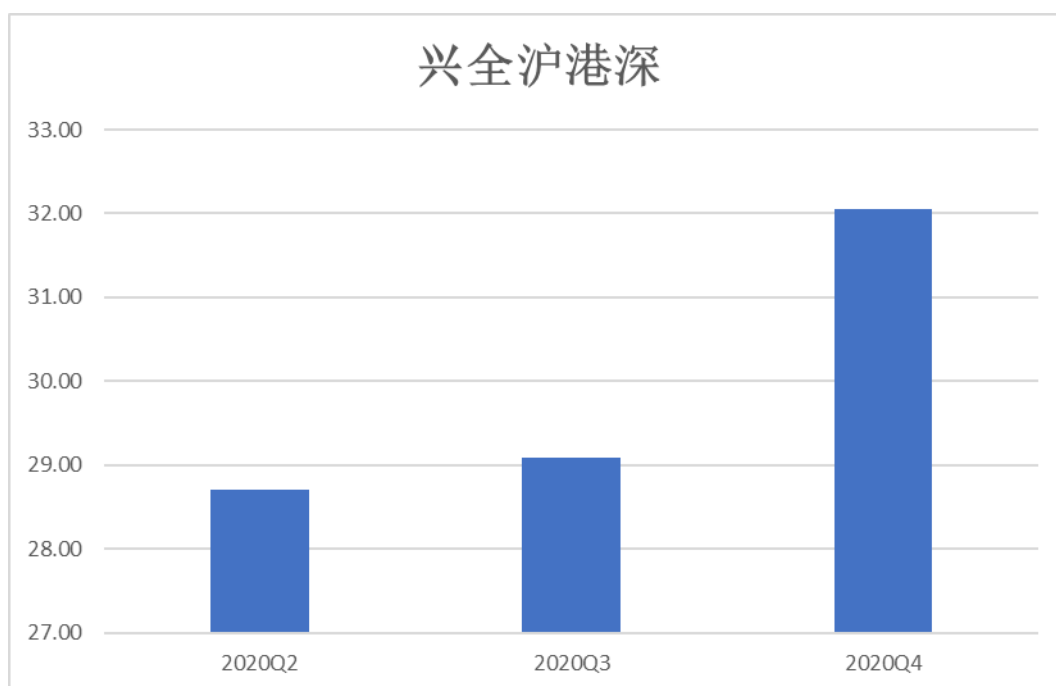
2、2020年12月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,905,903,703.18	90.19
	其中：股票	2,905,903,703.18	90.19
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	91,213,399.02	2.83
	其中：债券	91,213,399.02	2.83
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	210,355,576.08	6.53
8	其他资产	14,529,952.64	0.45
9	合计	3,222,002,630.92	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年三季度		2020 年四季度	
	规模变化		规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率	变化量 (亿元)	变化率
兴全沪港深	0.39	1.37%	2.96	10.17%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	9.83%	0.90%	10.37%	0.84%	-0.54%	0.06%
过去六个月	9.26%	1.00%	4.55%	0.98%	4.71%	0.02%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

三十二、兴全汇享一年持有期混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在有效控制投资组合风险的前提下，把握股票市场、债券市场的投资机会，通过积极主动的投资管理，力求实现资产净值的长期稳健增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、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、证券公司短期公司债券、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。

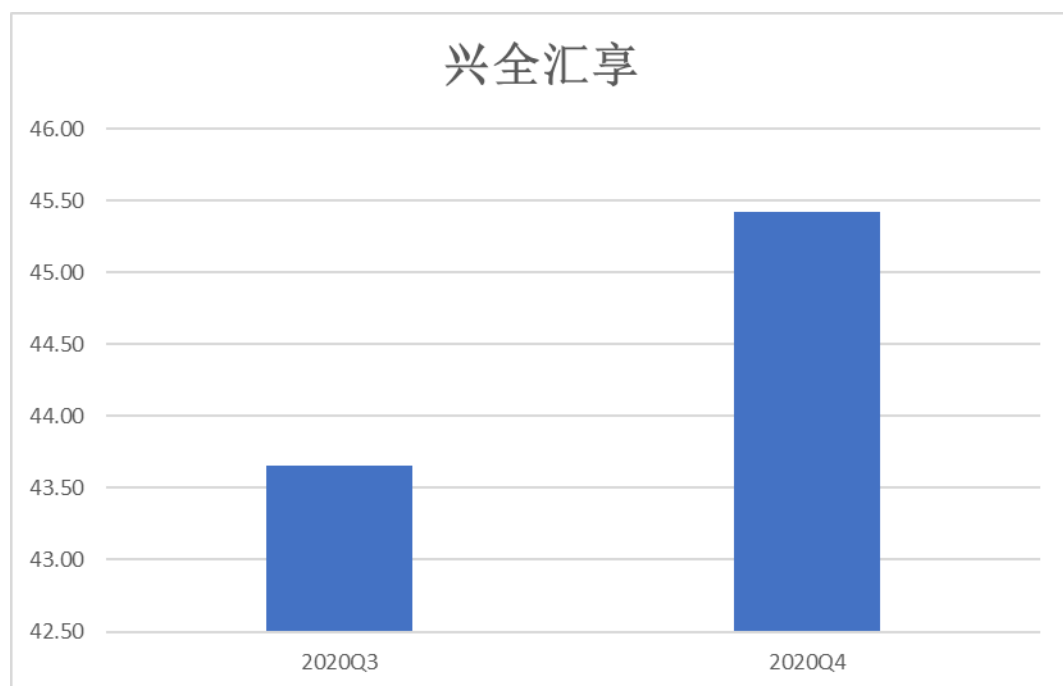
基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 0%—40%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%）；同业存单投资占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	952,644,489.50	16.44
	其中：股票	952,644,489.50	16.44
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	4,590,929,539.76	79.23
	其中：债券	4,590,929,539.76	79.23
	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	50,000,000.00	0.86
	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	56,205,819.10	0.97
8	其他资产	144,899,087.74	2.50
9	合计	5,794,678,936.10	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年四季度	
	规模变化	
	变化量（亿元）	变化率

兴全汇享	1.76	4.03%
------	------	-------

4、本基金最近半年业绩与波动程度

兴全汇享 A 类份额：

阶段	净值增长率①	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	3.51%	0.27%	2.41%	0.13%	1.10%	0.14%
自基金合同生效起至今	5.30%	0.29%	0.76%	0.15%	4.54%	0.14%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

兴全汇享 C 类份额：

阶段	净值增长率①	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	3.46%	0.27%	2.41%	0.13%	1.05%	0.14%
自基金合同生效起至今	5.20%	0.29%	0.76%	0.15%	4.44%	0.14%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

三十三、兴全恒祥 88 个月定期开放债券型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，主要投资于债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具等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的相关规定）。

本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金投资的信用债的信用评级为 AA 级及以上，本基金对信用评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的信用评级。

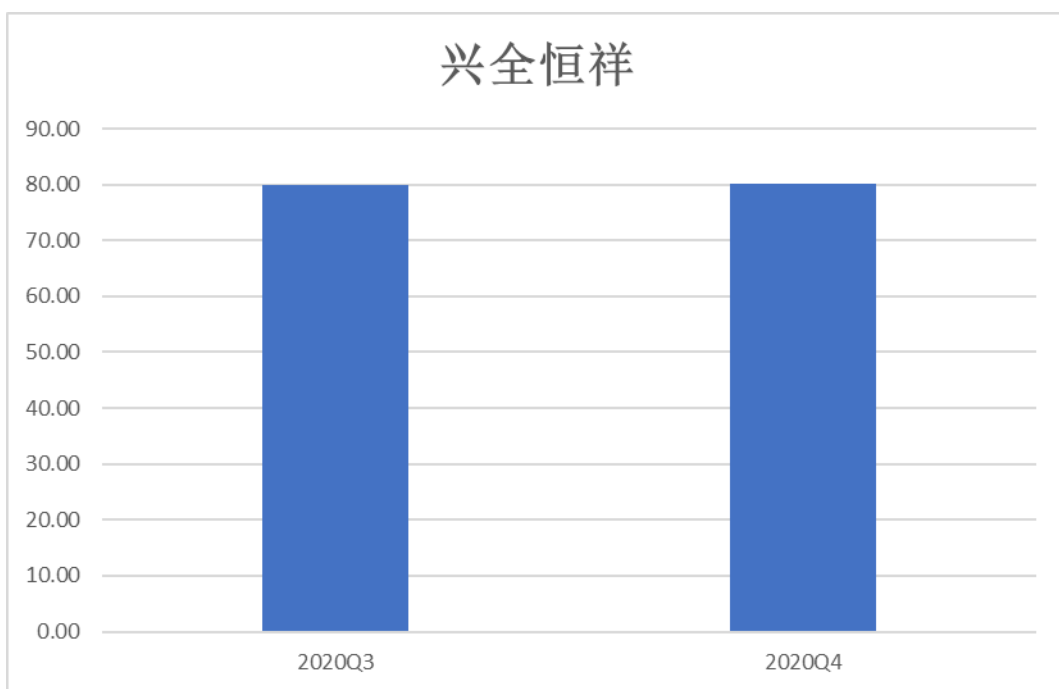
基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，但每个开放期的前 3 个月、后 3 个月以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。开放期内，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	12,989,056,806.87	98.54
	其中：债券	12,989,056,806.87	98.54
	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	4,811,873.84	0.04
8	其他资产	187,890,542.23	1.43
9	合计	13,181,759,222.94	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年四季度	
	规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率
兴全恒祥	0.23	0.28%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	1.02%	0.01%	0.83%	0.01%	0.19%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.53%	0.01%	1.36%	0.01%	0.17%	0.00%

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R2。

三十四、兴全合丰三年持有混合型基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

本基金在有效控制投资组合风险的前提下，通过深入的基本面研究挖掘具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，力求实现资产净值的长期稳健增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、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、证券公司短期公司债券、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60%—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，在扣除股指期货和国债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。

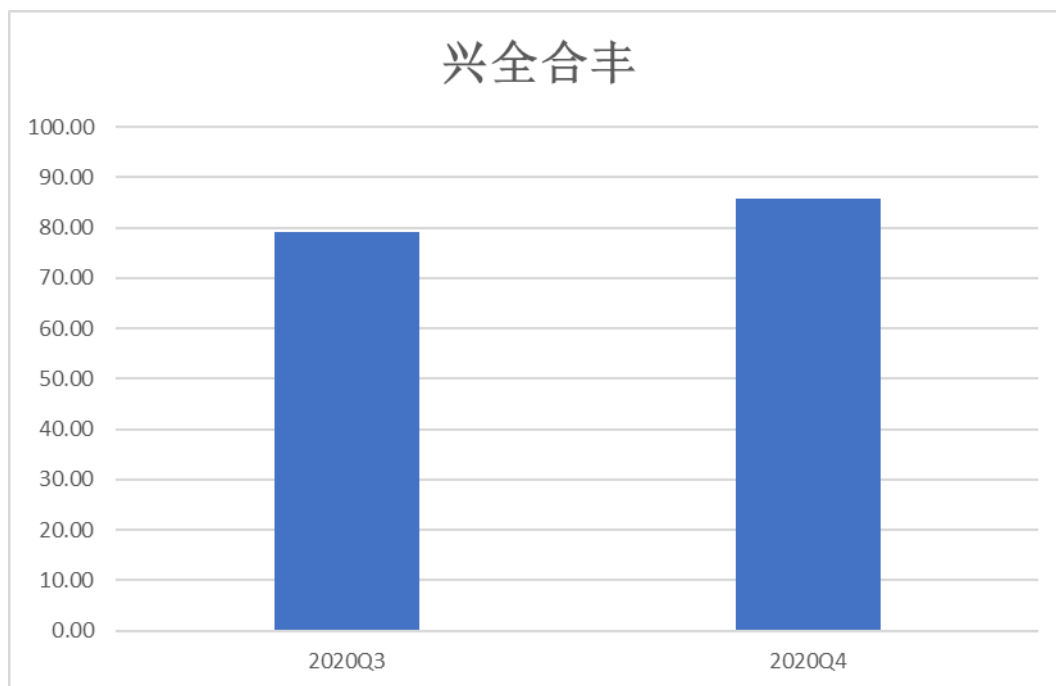
2、2020年12月底各类资产持仓比例

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,993,944,398.33	92.46
	其中：股票	7,993,944,398.33	92.46
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	408,198,522.10	4.72
	其中：债券	408,198,522.10	4.72
	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	225,664,389.46	2.61
8	其他资产	17,923,720.52	0.21
9	合计	8,645,731,030.41	100.00

3、本基金历史规模

单位：亿元



本基金最近一年各季度资产规模变化情况

基金名称	2020 年四季度	
	规模变化	
	变化量 (亿元)	变化率
兴全合丰	6.57	8.30%

4、本基金最近半年业绩与波动程度

阶段	净值增长率①	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	13.47%	1.22%	10.50%	0.70%	2.97%	0.52%

自基金合同 生效起至今	7.49%	1.20%	6.59%	0.75%	0.90%	0.45%
----------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

截止日期：2020 年 12 月 31 日

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级：R3。

三十五、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%。本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 20%，投资比例范围为基金资产的 10%-25%。

其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

- 1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；
- 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。

同时，股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 30%。

本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

截至 2020 年 12 月底。该基金《基金合同》生效不足 2 个月，基金管理人未编制 2020 年第 4 季度报告，因此未披露基金各类资产持仓比例。

3、本基金历史规模

不适用。

4、本基金最近半年业绩与波动程度

不适用。

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级： R3。

三十六、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金

1、基金投资目标、投资范围和投资比例：

在控制风险的前提下，本基金主要通过成熟稳健的资产配置策略和公募基金精选策略进行投资，力求基金资产的长期稳健增值，满足投资者的养老资金理财需求。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票及存托凭证

（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

本基金不投资具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

本基金投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%。本基金投资于权益类资产（股票、股票型基金、混合型基金）的战略配置目标比例中枢为 70%，投资比例范围为基金资产的 60%-75%。

其中，计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：

- 1、基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产 60%的混合型基金；
- 2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票资产占基金资产比例均不低于 60%的混合型基金。

同时，股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的投资比例合计不得超过基金资产的 80%。

本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、2020 年 12 月底各类资产持仓比例

截至 2020 年 12 月底。该基金《基金合同》生效不足 2 个月，基金管理人未编制 2020 年第 4 季度报告，因此未披露基金各类资产持仓比例。

3、本基金历史规模

不适用。

4、本基金最近半年业绩与波动程度

不适用。

5、基金风险评价期内有无违规行为

无。

依据《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》，结合上述指标给予该基金的风险等级： R3。

旗下基金风险评价结果汇总（截止至 2021 年 1 月 1 日）

被评估时间段	基金名称	风险等级	基金合同约定的基金风险收益特征
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全趋势投资基金	R3	在混合型基金中属于中高风险、中高回报的基金产品
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全可转债基金	R3	本基金所承担的风险水平接近于普通债券并明显低于股票和股票基金；而收益水平接近于股票并高于国债、金融债、企业债券，以及以这些投资品种为投资对象的基金产品。总体而言，本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全全球视野基金	R3	较高风险、较高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全社会责任基金	R3	较高风险、较高回报
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全有机增长基金	R3	中高风险、中高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全磐稳债券基金	R2	预计长期平均风险与收益低于股票型、混合型以及可转债证券投资基金，高于货币市场基金
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全货币市场基金	R1	属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全合润基金 ¹	R3	较高风险、较高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全沪深 300 基金	R3	本基金属于股票型基金，预期风险和收益高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。本基金为指数增强型基金，是股票基金中处于中等风险水平的基金。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全绿色投资基金	R3	中高风险、中高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全精选基金	R3	本基金为混合型基金产品，预期风险与预期收益高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金品种。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全轻资产基金	R3	较高风险、较高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全商业模式优选基金	R3	中高风险、中高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全添利宝货币市场基金	R1	低风险品种
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全新视野混合型基金	R3	中高风险、中高收益
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全稳益定期开放债券型发起式基金	R2	属证券投资基金中的较低预期风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全天添益货币市场基金	R1	低风险品种
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全稳泰债券基金	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/

¹ 兴全合润分级混合型证券投资基金之合润 A 份额和合润 B 份额于 2021 年 1 月 4 日终止上市（最后交易日为 2020 年 12 月 31 日），基金名称于 2021 年 1 月 1 日起变更为“兴全合润混合型证券投资基金”。

			收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全兴泰定期开放债券型发起式基金	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全恒益债券基金	R3	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全祥泰定期开放债券型发起式基金	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全合宜混合型基金	R3	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。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全安泰平衡养老目标三年持有（FOF）	R3	预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全恒裕债券型基金	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/较低收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全多维价值混合型基金	R3	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。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全恒瑞债券型基金	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全合泰混合型基金	R3	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。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全社会价值三年持有混合型基金	R3	预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全恒鑫债券型基金	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/较低收益的产品。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全优选进取三个月持有（FOF）	R3	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全沪港深两年持有期混合型基金	R3	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。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全汇享一年持有期混合型基金	R3	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。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全恒祥 88 个月定期开	R2	预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

	放债券型基金		
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全合丰三年持有期混合型基金	R3	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。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全安泰稳健养老目标一年持有（FOF）	R3	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。
截止至 2021 年 1 月 1 日	兴全安泰积极养老目标五年持有（FOF）	R3	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金、债券型基金中基金、货币市场基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

注：公司旗下基金产品 R1-R5 的风险评级划分，是基于《兴证全球基金管理有限公司产品风险评价管理办法》的具体要求，与基金合同中原有的“风险收益特征”主要考虑基金投资方向等投资要素不同，上述划分标准更为全面，充分考虑了流动性、到期期限、杠杆情况、产品的结构复杂性、同类产品过往业绩等多种要素确定产品所属 R1-R5 的级别。