

# 兴全优选进取三个月持有期混合型基金中 基金（FOF） 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 03 月 06 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	58
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 本报告期投资基金情况 .....	58
8.13 投资组合报告附注 .....	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>68</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	68
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	69
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>69</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	69
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.9 其他重大事件 .....	71
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>74</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）
基金简称	兴全优选进取三个月持有混合 FOF
基金主代码	008145
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 6 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,212,939,287.60 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金每份基金份额最短持有期为 3 个月。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下,通过优选基金积极把握基金市场的投资机会,力求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金的投资策略包括：</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>通过对各类资产的长期收益率、波动率、相关性的计算与分析，结合对宏观经济及市场策略的研究，判断宏观经济发展趋势、政策导向、市场未来的发展趋势，从而形成对各类资产的未来收益能力和潜在风险水平的判断与比较，基于大类资产比较结果进行配置，并在一定的范围内动态调整各类资产在组合中的比例。</p> <p>本基金是基金中基金，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%，同时，本基金会将拟投资的资产分为权益类资产和非权益类资产两类。权益类资产主要包括股票、股票型基金以及混合型基金等，非权益类资产主要包括各类债券、债券型基金、货币市场型基金等固收类资产。</p> <p>本基金原则上以权益类资产为主要投资方向，本基金的权益类资产投资比例中枢为 80%。通过大类资产配置策略最终决定权益类基金在本基金组合中的占比。同时，在权益类基金内部，将根据不同的风险收益特征和投资风格对基金进行分类，建立相应的分析跟踪模型，在既定的投资范围和投资策略内进行基金类别比例的配置。</p> <p>具体来说，本基金将通过战略资产配置策略（SAA）和战术资产配置策略（TAA）的动态结合，确定并优化投资组合的资产配置比例。</p> <p>第一，战略型资产配置策略（SAA）</p> <p>在中长期时间维度内，本基金在基金合同给定范围内确定战略资产配置的最优比例，并以此作为资产配置调整的中枢。主要考虑大类资产的长期收益率、历史波动率、各类资产之间的相关性、再平衡等因素。</p> <p>第二，战术型资产配置策略（TAA）</p> <p>在较短的投资期限内，本基金将通过对大类资产风险收益比的评估</p>

与调整，抓住相对价值变化和事件驱动带来的投资机会，对组合进行战术型资产配置调整，以提高组合的风险调整后收益水平。本基金在进行战术型资产配置调整时，重点跟踪和评估如下四个因素：

（1）估值因素，本基金定期分析判断股票市场的相对估值与绝对估值水平，一方面与其历史估值水平比较，另一方面也通过 FED 模型与债券收益率比较，从而相对客观的评估股票市场目前的估值情况；

（2）宏观因素，本基金跟踪的宏观指标包括国内生产总值、通货膨胀率、财政收支、进出口及国际收支、工业增加值及固定资产投资、利率走势、货币政策和财政政策等指标。通过对上述宏观指标以及其与市场预期差异的跟踪和分析，评估宏观经济发展趋势；

（3）流动性因素，本基金紧密跟踪市场上资金供给和需求情况及其历史变化趋势，以判断目前市场的资金流向和投资者情绪的变化情况，同时评估可能影响未来流动性的因素，包括 IPO 政策变化、央行公开市场操作等；

（4）政策因素，本基金将密切关注与股票市场直接相关的政策出台或变化，并评估其对市场未来发展趋势的影响。

## 2、优选基金策略

本基金在确定大类资产配置基础上，对于子基金的选择，分为主动管理影响较小的基金和主动管理影响较大的基金两种类型：

主动管理影响较小的基金（如指数基金、ETF 基金等）：主要从定量的角度分析其跟踪误差、信息比率、规模、流动性以及费率等情况；

主动管理影响较大的基金（主动管理基金）：搭建以“基金经理”为主要研究对象的研究体系，本基金倾向于选择长期业绩相对较好、投资风格稳定、盈利模式可持续的基金经理管理的基金。

具体操作方面，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资。定性研究主要指根据与基金经理进行访谈和调研的方式对基金管理人的盈利模式、风格特点及投资理念研究，定量研究主要包括：

业绩分析：主要包括相对收益、绝对收益、风险调整后收益等关注方向；

归因分析：主要包括择时能力、行业配置能力、选股能力等；

持仓分析：在行业配置层面，主要观察行业集中度、行业偏离度、行业轮换度等指标；在重仓股层面，主要关注重仓股的市盈率、市净率、PEG、流动性水平等指标。通过动态跟踪基金整体持仓的变化，评估基金风格的稳定性；

容量分析：通过分析基金风格和基金管理人的既往历史业绩，分析基金比较适合的资金容量；

风险控制能力：主要考察下行标准差、区间最大回撤、VaR 等指标；在定性和定量分析的基础上，形成基金库，进行持续跟踪评估，并依此建立基金中基金组合，从而获取长期稳定的超额收益。

## 3、股票投资策略

本基金通过结合证券市场趋势，并以基本面研究为基础，精选基本面良好，具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，寻找股票的超预期机会。在考察个股的估值水平时，本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资

	<p>产)、市销率(市值/营业收入)等指标考察股票的价值是否被低估。本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。在盈利水平方面,本基金重点考察主营业务收入、经营现金流、盈利波动程度三个关键指标,以衡量具有高质量持续增长的公司。在定性指标方面,本基金综合考察诸如成长模式、轻资产经营方式、商业模式、行业壁垒以及渠道控制力、公司治理等方面,从而给以相应的折溢价水平,并最终确定股票合理价格区间。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略,发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出的。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。</p> <p>6、证券公司短期公司债券投资策略</p> <p>从个券选择上,本基金根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选,并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。本基金将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测,尽量选择流动性相对较好的品种进行投资,保证本基金的流动性。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合(全价)指数收益率×20%
风险收益特征	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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	郭明
	联系电话	021-20398888	010-66105799
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95588
传真		021-20398858	010-66105798
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-30 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		201204	100140
法定代表人		杨华辉	陈四清

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

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	236,597,009.77
本期利润	924,585,350.65
加权平均基金份额本期利润	0.3751
本期加权平均净值利润率	31.35%
本期基金份额净值增长率	37.70%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	313,096,685.14
期末可供分配基金份额利润	0.0974
期末基金资产净值	4,424,157,195.84
期末基金份额净值	1.3770
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	37.70%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

4、本基金成立于 2020 年 3 月 6 日

## 3.2 基金净值表现

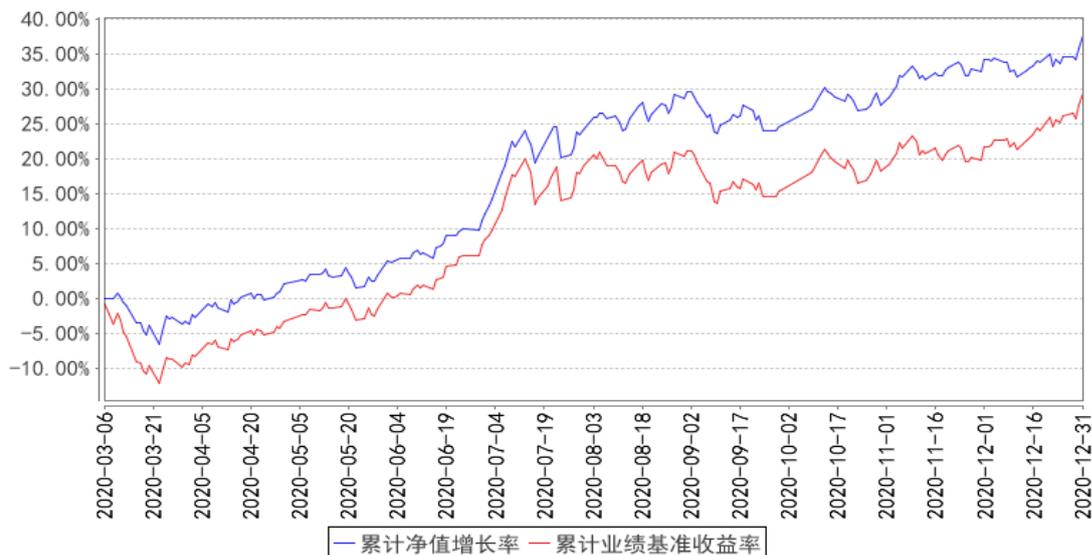
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	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%
自基金合同生效起至今	37.70%	0.95%	29.49%	1.11%	8.21%	-0.16%

注：本基金成立于2020年3月6日，截至2020年12月31日，本基金成立不满一年。

### 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

兴全优选进取三个月持有混合FOF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



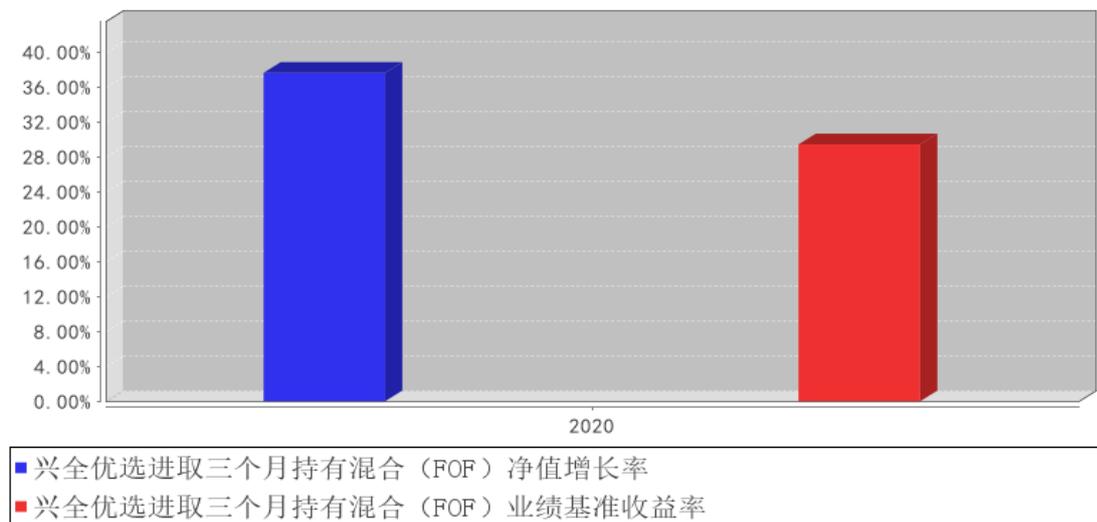
注：1、净值表现所取数据截至到2020年12月31日。

2、按照《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）合同》的规定，本基金建仓期为2020年3月6日至2020年9月5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和投资组合的比例范围。

3、本基金成立于2020年3月6日，截至2020年12月31日，本基金成立不满一年。

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

兴全优选进取三个月持有混合（FOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：2020 年数据统计期间为 2020 年 3 月 6 日至 2020 年 12 月 31 日，数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自合同生效日（2020年3月6日）至2020年12月31日期间未进行利润分配

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至2020年12月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金、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、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金、兴全恒祥88个月定期开放债券型证券投资基金、兴全合丰三年持有期混合型证券投资基金、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、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（FOF）共36只基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林国怀	FOF 投资与金融工程部、养老金管理部 总监，本基金基金经理、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型	2020年3月6日	-	12年	经济学硕士。历任天相投资顾问有限公司基金分析师，瑞泰人寿保险基金组合投资经理，合众人寿资产管理中心基金组合投资经理，泰康资产管理有限公司执行总监，天安人寿资产管理中心权益投资部经理。

	基金中基金（FOF）基金经理、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理、兴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（FOF）基金经理				
丁凯琳	本基金的基金经理	2020 年 12 月 9 日	-	8 年	硕士，历任芝加哥商品交易所量化分析师，兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员、基金经理助理。
丁凯琳	本基金基金经理助理、兴全安泰平衡养老三年持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理助理	2020 年 3 月 6 日	2020 年 12 月 08 日	8 年	硕士，历任芝加哥商品交易所量化分析师，兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员。

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

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 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、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年市场受国内外新冠疫情的影响，一季度出现了较大幅度的震荡，但随着全球央行陆续大规模的释放流动性，市场资金面宽裕，全球股票市场均出现了较大幅度的上涨。以创业板 50

为代表的成长型指数涨幅领先，全年创业板 50 上涨 88.74%、创业板指数上涨 64.96%，而沪深 300 指数上涨 27.21%，价值风格的中证红利指数全年仅上涨 3.49%，风格分化显著。行业上也是分化明显，免税业务、新能源、消费医药等行业表现亮眼，而金融地产、通信、采掘等行业全年收跌；债券市场表现也是大幅震荡，整体表现较为一般。

从基金整体表现来看，代表权益基金整体表现的中证偏股基金指数上涨 51.50%，代表纯债基金整体表现的中长期纯债基金指数上涨 2.84%。

从本基金的运作情况来看，年初市场跌幅较大，3 月 6 日成立后，该基金在快速下跌的市场环境中采取了相对积极的建仓策略，具体表现在维持中性略偏高的权益仓位，积极参与市场上各种相对收益、绝对收益的投资机会，但组合对估值的容忍度相对偏低，对于强势板块上保持持续欠配。7 月初市场快速上涨，虽然我们对于宏观经济的持续性和市场流动性依然偏乐观，但是市场的估值水平已经相对偏高，在此背景下，我们适度调低了组合的权益仓位，降低了重仓配置于估值已处历史极高位置的板块的相关基金的比例，随后在震荡的市场环境下整体组合表现相对符合预期。12 月份，股票市场出现了再一次的风格分化，消费、医药、军工、新能源等板块大幅上涨，而其他很多传统周期行业出现了下跌，整体组合的超额收益出现了较大幅度的回撤。自成立以来，组合战胜业绩比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3770 元；本报告期基金份额净值增长率为 37.70%，业绩比较基准收益率为 29.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新基金发行情况持续火爆，经济数据稳步向好，在这样的宏观经济和流动性的背景下，市场继续表现强劲。但从另一个角度来看，从目前市场整体的估值水平所处历史百分位以及股债性价比的比较来看，股票市场整体处于风险较高的位置，政策面由松转紧的情况可能发生，所以该组合将采取适度防御的操作方式。首先，组合将保持中性略偏低的权益仓位，降低预期收益率；其次，继续降低组合中配置估值偏高板块的基金占比，而提升估值偏低的板块的基金占比；最后适度提升组合中偏绝对收益投资机会的品种占比。

之所以采取以上操作，和我们团队一贯的投资思路和逻辑相关，我们坚持在战略资产配置（对于本基金是 80%的权益资产和 20%的固定收益资产）的基础上，通过我们长期坚持的资产配置模型对不同资产之间的性价比进行比较，适度进行战术型资产配置调整，所以在操作上将体现为整体均衡、适度“左侧”的投资风格。

本基金是一只进取风格的普通 FOF 产品，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，遵守契

约要求、保持策略的稳定性，为持有人争取更高的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

临时信息披露。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

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

本基金本报告期内未发生基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的管理人——兴证全球基金管理有限公司在兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）未进行利润分配，情况真实、准确。

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

本托管人依法对兴证全球基金管理有限公司编制和披露的兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	德师报(审)字(21)第 P00192 号
--------	-----------------------

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 全体持有人
审计意见	<p>我们审计了兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2020 年 3 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 3 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	不适用
其他信息	<p>兴证全球基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 2020 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估兴全优选进</p>



审计报告日期	2021 年 03 月 29 日
--------	------------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	104,872,965.90
结算备付金		688,047.43
存出保证金		164,281.15
交易性金融资产	7.4.7.2	4,293,990,631.15
其中：股票投资		259,116,831.72
基金投资		3,745,788,856.73
债券投资		289,084,942.70
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		48,876,290.80
应收利息	7.4.7.5	2,218,884.88
应收股利		1,291,189.10
应收申购款		21,508,507.90
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		4,473,610,798.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		45,547,748.78
应付管理人报酬		2,604,000.03
应付托管费		609,232.05
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	204,294.24
应交税费		200,247.96

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	288,079.41
负债合计		49,453,602.47
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	3,212,939,287.60
未分配利润	7.4.7.10	1,211,217,908.24
所有者权益合计		4,424,157,195.84
负债和所有者权益总计		4,473,610,798.31

注：1、报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3770 元，基金份额总额 3,212,939,287.60 份。

2、本基金合同于 2020 年 3 月 6 日生效，本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		949,261,897.93
1. 利息收入		2,225,205.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	742,045.51
债券利息收入		1,393,562.93
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		89,597.40
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		254,695,594.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	101,606,109.13
基金投资收益	7.4.7.13	96,271,500.85
债券投资收益	7.4.7.14	414,077.93
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	56,403,906.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	687,988,340.88
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	4,352,756.31
减：二、费用		24,676,547.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	17,317,081.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,121,840.84
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	2,988,136.54
5. 利息支出		6,920.86
其中：卖出回购金融资产支出		6,920.86
6. 税金及附加		57,658.74
7. 其他费用	7.4.7.21	184,909.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		924,585,350.65
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		924,585,350.65

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全优选进取三个月持有期混合型证券投资基金（FOF）

本报告期：2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,978,308,637.71	-	1,978,308,637.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	924,585,350.65	924,585,350.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,234,630,649.89	286,632,557.59	1,521,263,207.48
其中：1. 基金申购款	2,793,687,830.23	646,694,883.62	3,440,382,713.85
2. 基金赎回款	-1,559,057,180.34	-360,062,326.03	-1,919,119,506.37
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	3,212,939,287.60	1,211,217,908.24	4,424,157,195.84

权益(基金净值)			
----------	--	--	--

注：本基金合同于 2020 年 3 月 6 日生效，本期数据按实际存续期计算

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

杨华辉	庄园芳	詹鸿飞
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴证全球基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金(FOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1862 号文准予公开募集注册。本基金为契约型、开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 1,978,308,637.71 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(19)第 00120 号验资报告。基金合同于 2020 年 3 月 6 日正式生效。本基金的基金管理人为兴证全球基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

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。

本基金的业绩比较基准为中证偏股型基金指数收益率×80%+中债综合(全价)指数收益率×20%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)

以及中国证监会发布的基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

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

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产分类

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

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

##### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债

的公允价值变动计入当期损益。

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

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### （1） 股票投资

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

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

#### （2） 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益；卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

#### （3） 基金投资

买入基金于成交日确认为基金投资，基金投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出基金于成交日确认基金投资收益，卖出基金的成本按移动加权平均法于成交日结转。

#### （4） 回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

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

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

(7) 基金投资收益/（损失）于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额与其成本的差额入账。

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%的年费率逐日计提；
- (2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；
- (3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- (3) 每一基金份额享有同等分配权；
- (4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

- (1) 对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布〈基金中基金估值业务指引(试行)〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引(试行)》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值。
- (2) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发

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

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

(4) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

5) 基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
活期存款	104,872,965.90
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	104,872,965.90

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	225,987,352.33	259,116,831.72	33,129,479.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	140,402,813.51	139,691,942.70
	银行间市场	148,701,170.00	149,393,000.00
	合计	289,103,983.51	289,084,942.70
资产支持证券	-	-	-
基金	3,090,910,954.43	3,745,788,856.73	654,877,902.30
其他	-	-	-
合计	3,606,002,290.27	4,293,990,631.15	687,988,340.88

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	12,568.48
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	309.70
应收债券利息	2,205,932.80
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	73.90
合计	2,218,884.88

## 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	204,294.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	204,294.24

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	133,079.41
应付证券出借违约金	-
预提审计费用	55,000.00
预提信息披露费	100,000.00
合计	288,079.41

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,978,308,637.71	1,978,308,637.71
本期申购	2,793,687,830.23	2,793,687,830.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,559,057,180.34	-1,559,057,180.34
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,212,939,287.60	3,212,939,287.60

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	236,597,009.77	687,988,340.88	924,585,350.65
本期基金份额交易产生的变动数	76,499,675.37	210,132,882.22	286,632,557.59
其中：基金申购款	156,273,959.32	490,420,924.30	646,694,883.62

基金赎回款	-79,774,283.95	-280,288,042.08	-360,062,326.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	313,096,685.14	898,121,223.10	1,211,217,908.24

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
活期存款利息收入		696,080.54
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		23,850.60
其他		22,114.37
合计		742,045.51

注：此处其他列示的是保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		101,606,109.13
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		101,606,109.13

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
卖出股票成交总额		273,969,929.69
减：卖出股票成本总额		172,363,820.56
买卖股票差价收入		101,606,109.13

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	970,139,295.60
减：卖出/赎回基金成本总额	873,867,794.75
基金投资收益	96,271,500.85

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	414,077.93
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	414,077.93

##### 7.4.7.14.2 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3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,210,963.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,781,621.79
减：应收利息总额	15,263.56
买卖债券差价收入	414,077.93

##### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

注：基金在本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

##### 7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,805,601.79
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	53,598,305.20
合计	56,403,906.99

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	687,988,340.88
股票投资	33,129,479.39
债券投资	-19,040.81
资产支持证券投资	-
基金投资	654,877,902.30
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	687,988,340.88

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	4,352,756.31
合计	4,352,756.31

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	861,199.53
银行间市场交易费用	825.00
交易基金产生的费用	2,126,112.01
其中：申购费	131,813.72
赎回费	717,648.66
交易费	62,104.11
转换费	1,214,545.52
合计	2,988,136.54

#### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	121,663.08

当期持有基金产生的应支付管理费（元）	23,323,239.44
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	4,030,542.93

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

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年 12月31日
审计费用	55,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
银行手续费	25,409.22
账户维护费用	4,500.00
合计	184,909.22

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司(简称“兴证全球基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(简称“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(简称“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
全球人寿保险国际公司(AEGON International B.V)	基金管理人的股东
兴证全球资本管理(上海)有限公司(简称“兴证全球资本”)	基金管理人控制的公司

注：1、本基金的基金管理人于2020年3月18日由“兴全基金管理有限公司”更名为“兴证全球基金管理有限公司”。基金管理人控制的公司于2020年6月19日由“上海兴全睿众资产管理有限公司”更名为“兴证全球资本管理(上海)有限公司”。

2、下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	398,183,662.51	75.67

## 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
兴业证券	129,583,506.37	82.67

## 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	600,000,000.00	100.00

## 7.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
兴业证券	1,752,375,539.48	92.28

## 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
兴业证券	272,471.43	69.42	84,243.45	41.24

注：1、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	10,063,869.85

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00%的年费率计提。计算方式如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方式如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

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

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

注：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。

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

注：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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：本报告期内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	104,872,965.90	696,080.54

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本报告期末本基金持有基金管理人兴证全球基金管理有限公司所管理的基金合计1,241,617,774.46元，占本基金资产净值的比例为28.06%。

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

项目	本期费用
	2020年3月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
当期交易基金产生的申购费（元）	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	126,434.29
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	8,867,654.34
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,527,520.97
-	-

注：1. 当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

2. 根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000050	深天马A	2020年9月8日	2021年3月	非公开发	13.66	14.29	366,032	4,999,997.12	5,230,597.28	-

		日	10日	行 流 通 受 限							
000584	哈工 智能	2020年 8月14 日	2021 年2月 18日	非公 开发 行流 通受 限	4.68	5.70	854,701	4,000,000.68	4,871,795.70	-	
000785	居然 之家	2020年 12月1 日	2021 年6月 2日	非公 开发 行流 通受 限	7.06	7.97	991,501	6,999,997.06	7,902,262.97	-	
000895	双汇 发展	2020年 10月 16日	2021 年4月 19日	非公 开发 行流 通受 限	48.15	45.11	145,379	6,999,998.85	6,558,046.69	-	
002782	可立 克	2020年 9月16 日	2021 年3月 17日	非公 开发 行流 通受 限	11.45	12.63	436,681	4,999,997.45	5,515,281.03	-	
002891	中宠 股份	2020年 10月 29日	2021 年4月 30日	非公 开发 行流 通受 限	37.50	54.62	186,666	6,999,975.00	10,195,696.92	-	
003030	祖名 股份	2020年 12月 25日	2021 年1月 6日	新股 流通 受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-	
003031	中瓷 电子	2020年 12月 24日	2021 年1月 4日	新股 流通 受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-	
300017	网宿 科技	2020年 9月3 日	2021 年3月 3日	大宗 交易 流通 受限	8.59	6.70	600,000	5,154,000.00	4,020,000.00	-	
300075	数字 政通	2020年 9月2 日	2021 年3月 4日	非公 开发 行流 通受 限	12.50	11.30	320,000	4,000,000.00	3,616,000.00	-	
300174	元力	2020年	2021	非公	13.57	16.51	294,767	3,999,988.19	4,866,603.17	-	

	股份	7月10日	年1月15日	开发 行流 通受 限						
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300866	安克创新	2020年8月11日	2021年2月24日	新股流通受限	66.32	156.18	9,451	626,790.32	1,476,057.18	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新股流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300870	欧陆通	2020年8月13日	2021年2月24日	新股流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-
300871	回盛生物	2020年8月13日	2021年2月24日	新股流通受限	33.61	38.70	618	20,770.98	23,916.60	-
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年02月25日	新股流通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年2月24日	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年03月18日	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月	新股流通	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-

		日	17日	受限						
300894	火星 人	2020年 12月 24日	2021 年7月 1日	新股 流通 受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300896	爱美 客	2020年 9月21 日	2021 年3月 29日	新股 流通 受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300900	广联 航空	2020年 10月 19日	2021 年4月 29日	新股 流通 受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安 达	2020年 10月 22日	2021 年4月 29日	新股 流通 受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景 食品	2020年 11月 13日	2021 年5月 24日	新股 流通 受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创 达	2020年 11月 11日	2021 年5月 18日	新股 流通 受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300911	亿田 智能	2020年 11月 24日	2021 年6月 3日	新股 流通 受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300913	兆龙 互连	2020年 11月 27日	2021 年6月 7日	新股 流通 受限	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300917	特发 服务	2020年 12月 14日	2021 年6月 21日	新股 流通 受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300919	中伟 股份	2020年 12月 15日	2021 年6月 23日	新股 流通 受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300922	天秦 装备	2020年 12月 18日	2021 年6月 25日	新股 流通 受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本 信息	2020年 12月 21日	2021 年6月 30日	新股 流通 受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊 科技	2020年 12月 29日	2021 年1月 7日	新股 流通 受限	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊 科技	2020年 12月 29日	2021 年7月 7日	新股 流通 受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天	2020年	2021	新股	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-

	化学	12月29日	2021年1月7日	流通受限						
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新股流通受限	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
600095	湘财股份	2020年8月10日	2021年2月8日	非公开发行流通受限	9.39	14.01	425,985	3,999,999.15	5,968,049.85	注1
600141	兴发集团	2020年11月24日	2021年5月20日	非公开发行流通受限	9.01	10.41	694,309	6,255,724.09	7,227,756.69	-
600496	精工钢构	2020年9月1日	2021年3月1日	非公开发行流通受限	4.94	4.33	1,012,146	5,000,001.24	4,382,592.18	-
600556	天下秀	2020年9月18日	2021年3月16日	非公开发行流通受限	16.65	12.15	300,300	4,999,995.00	3,648,645.00	-
600727	鲁北化工	2020年9月25日	2021年3月23日	非公开发行流通受限	6.19	6.73	1,292,407	7,999,999.33	8,697,899.11	-
601995	中金公司	2020年10月22日	2021年5月6日	新股流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
603229	奥翔药业	2020年12月23日	2021年6月21日	非公开发行流通受限	27.62	33.47	289,645	7,999,994.90	9,694,418.15	-
603816	顾家家居	2020年7月24日	2021年1月25日	大宗交易流通	54.33	69.17	80,000	4,346,400.00	5,533,600.00	-

				受限						
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688099	晶晨股份	2020年11月6日	2021年5月6日	大宗交易流通受限	63.56	74.06	110,000	6,991,600.00	8,146,600.00	-
688122	西部超导	2020年12月4日	2021年6月3日	询价转让流通受限	48.61	72.14	105,042	5,106,091.62	7,577,729.88	-
688136	科兴制药	2020年12月3日	2021年06月14日	新股流通受限	22.33	34.59	4,981	111,225.73	172,292.79	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年7月7日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688658	悦康药业	2020年12月16日	2021年6月24日	新股流通受限	24.36	22.31	16,580	403,888.80	369,899.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113044	大秦转债	2020年12月16日	2021年1月15日	新发未上市	100.00	100.00	16,950	1,695,000.00	1,695,000.00	-

注：1、经上海证券交易所核准，公司证券简称自2020年9月30日起由“哈高科”变更为“湘财股份”。

2、上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券的 10%，投资于单只基金市值不高于本基金资产净值的 20%。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有除国债、政策性金融债和央行票据以外的按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日
AAA	41,103,725.14
AAA 以下	28,528,097.00
未评级	-
合计	69,631,822.14

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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在最短持有期到期后可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等；持有的利率敏感性负债主要是卖出回购金融资产款。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	104,872,965.90	-	-	-	-	-	104,872,965.90
结算备付金	688,047.43	-	-	-	-	-	688,047.43
存出保证金	164,281.15	-	-	-	-	-	164,281.15
交易性金融资产	-	-	219,453,120.56	54,041,078.30	15,590,743.84	4,004,905,688.45	4,293,990,631.15
应收利息	-	-	-	-	-	2,218,884.88	2,218,884.88

应收股利	-	-	-	-	-	1,291,189.10	1,291,189.10
应收申购款	306,431.07	-	-	-	-	21,202,076.83	21,508,507.90
应收证券清算款	-	-	-	-	-	48,876,290.80	48,876,290.80
资产总计	106,031,725.55	-	219,453,120.56	54,041,078.30	15,590,743.84	4,078,494,130.06	4,473,610,798.31
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	45,547,748.78	45,547,748.78
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,604,000.03	2,604,000.03
应付托管费	-	-	-	-	-	609,232.05	609,232.05
应付交易费用	-	-	-	-	-	204,294.24	204,294.24
应交税费	-	-	-	-	-	200,247.96	200,247.96
其他负债	-	-	-	-	-	288,079.41	288,079.41
负债总计	-	-	-	-	-	49,453,602.47	49,453,602.47
利率敏感度缺口	106,031,725.55	-	219,453,120.56	54,041,078.30	15,590,743.84	4,029,040,527.59	4,424,157,195.84

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；	
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)
		本期末(2020年12月31日)
	利率 +1%	-910,173.10
	利率 -1%	918,788.90

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。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资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。本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	259,116,831.72	5.86
交易性金融资产—基金投资	3,745,788,856.73	84.67
交易性金融资产—债券投资	289,084,942.70	6.53
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	4,293,990,631.15	97.06

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

	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12月31日）
分析	业绩比较基准+10%	369,092,604.81
	业绩比较基准-10%	-369,092,604.81

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

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 7,786,525,491.83 元，第二层次的余额为人民币 615,617,428.60 元，无属于第三层次的余额。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	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	其他各项资产	74,059,153.83	1.66
9	合计	4,473,610,798.31	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,753,608.00	0.06
C	制造业	164,191,749.13	3.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,122,776.00	0.03
E	建筑业	1,062,089.00	0.02
F	批发和零售业	8,645,392.97	0.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,405,988.00	0.05
H	住宿和餐饮业	937,846.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,681,618.73	0.65
J	金融业	27,844,591.46	0.63

K	房地产业	10,792,993.14	0.24
L	租赁和商务服务业	1,928,598.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	1,684,000.00	0.04
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	2,790,516.02	0.06
R	文化、体育和娱乐业	4,275,065.27	0.10
S	综合	-	-
	合计	259,116,831.72	5.86

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688099	晶晨股份	145,200	10,917,896.00	0.25
2	002891	中宠股份	186,666	10,195,696.92	0.23
3	603229	奥翔药业	289,645	9,694,418.15	0.22
4	603816	顾家家居	130,100	9,066,151.00	0.20
5	600727	鲁北化工	1,292,407	8,697,899.11	0.20
6	000785	居然之家	991,501	7,902,262.97	0.18
7	000895	双汇发展	171,879	7,801,956.69	0.18
8	688122	西部超导	105,042	7,577,729.88	0.17
9	600141	兴发集团	694,309	7,227,756.69	0.16
10	600095	湘财股份	425,985	5,968,049.85	0.13
11	002782	可立克	436,681	5,515,281.03	0.12
12	000050	深天马A	366,032	5,230,597.28	0.12
13	002415	海康威视	102,700	4,981,977.00	0.11
14	000584	哈工智能	854,701	4,871,795.70	0.11
15	300174	元力股份	294,767	4,866,603.17	0.11
16	600496	精工钢构	1,012,146	4,382,592.18	0.10
17	000002	万科A	147,800	4,241,860.00	0.10
18	300017	网宿科技	600,000	4,020,000.00	0.09
19	601166	兴业银行	184,400	3,848,428.00	0.09
20	601318	中国平安	42,400	3,687,952.00	0.08
21	600556	天下秀	300,300	3,648,645.00	0.08
22	300075	数字政通	320,000	3,616,000.00	0.08
23	600048	保利地产	219,400	3,470,908.00	0.08

24	601128	常熟银行	468,000	3,453,840.00	0.08
25	002050	三花智控	134,250	3,309,262.50	0.07
26	002475	立讯精密	58,900	3,305,468.00	0.07
27	601658	邮储银行	683,700	3,268,086.00	0.07
28	601012	隆基股份	33,700	3,107,140.00	0.07
29	600383	金地集团	227,500	3,071,250.00	0.07
30	000858	五粮液	10,000	2,918,500.00	0.07
31	600519	贵州茅台	1,400	2,797,200.00	0.06
32	600031	三一重工	77,800	2,721,444.00	0.06
33	002142	宁波银行	75,716	2,675,803.44	0.06
34	601995	中金公司	35,799	2,530,912.17	0.06
35	300760	迈瑞医疗	5,700	2,428,200.00	0.05
36	601601	中国太保	62,800	2,411,520.00	0.05
37	600009	上海机场	31,800	2,405,988.00	0.05
38	002851	麦格米特	69,700	2,373,982.00	0.05
39	002444	巨星科技	75,200	2,339,472.00	0.05
40	600309	万华化学	25,300	2,303,312.00	0.05
41	300454	深信服	9,100	2,256,891.00	0.05
42	002841	视源股份	19,600	2,254,588.00	0.05
43	300999	金龙鱼	22,914	2,239,401.06	0.05
44	002920	德赛西威	26,400	2,221,296.00	0.05
45	000333	美的集团	22,500	2,214,900.00	0.05
46	300144	宋城演艺	120,700	2,138,804.00	0.05
47	300413	芒果超媒	28,800	2,088,000.00	0.05
48	600426	华鲁恒升	55,100	2,055,230.00	0.05
49	002938	鹏鼎控股	40,400	2,006,668.00	0.05
50	002007	华兰生物	46,500	1,964,160.00	0.04
51	002001	新和成	57,660	1,941,988.80	0.04
52	002027	分众传媒	195,400	1,928,598.00	0.04
53	601799	星宇股份	9,300	1,864,650.00	0.04
54	600887	伊利股份	40,600	1,801,422.00	0.04
55	600741	华域汽车	62,100	1,789,722.00	0.04
56	300271	华宇软件	73,600	1,756,832.00	0.04
57	000651	格力电器	27,800	1,721,932.00	0.04
58	601899	紫金矿业	183,000	1,700,070.00	0.04
59	603259	药明康德	12,500	1,684,000.00	0.04
60	300015	爱尔眼科	22,300	1,670,047.00	0.04
61	002555	三七互娱	53,100	1,658,313.00	0.04
62	002429	兆驰股份	261,000	1,618,200.00	0.04
63	603369	今世缘	27,400	1,572,212.00	0.04
64	002311	海大集团	24,000	1,572,000.00	0.04
65	002773	康弘药业	31,209	1,502,713.35	0.03

66	300866	安克创新	9,451	1,476,057.18	0.03
67	688233	神工股份	33,600	1,468,992.00	0.03
68	002600	领益智造	116,300	1,394,437.00	0.03
69	000768	中航西飞	36,300	1,331,484.00	0.03
70	600690	海尔智家	44,400	1,296,924.00	0.03
71	600521	华海药业	36,500	1,234,065.00	0.03
72	600276	恒瑞医药	11,000	1,226,060.00	0.03
73	300699	光威复材	13,500	1,202,175.00	0.03
74	603288	海天味业	5,700	1,143,078.00	0.03
75	600900	长江电力	58,600	1,122,776.00	0.03
76	002044	美年健康	98,894	1,120,469.02	0.03
77	601668	中国建筑	213,700	1,062,089.00	0.02
78	601168	西部矿业	85,100	1,053,538.00	0.02
79	000938	紫光股份	46,100	942,745.00	0.02
80	600754	锦江酒店	18,200	937,846.00	0.02
81	002398	垒知集团	118,500	921,930.00	0.02
82	000538	云南白药	8,100	920,160.00	0.02
83	600050	中国联通	173,800	775,148.00	0.02
84	603368	柳药股份	34,500	743,130.00	0.02
85	688658	悦康药业	16,580	369,899.80	0.01
86	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
87	688136	科兴制药	4,981	172,292.79	0.00
88	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
89	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.00
90	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
91	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
92	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
93	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
94	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
95	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
96	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
97	300871	回盛生物	618	23,916.60	0.00
98	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
99	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
100	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
101	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
102	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
103	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
104	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
105	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
106	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
107	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00

108	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
109	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
110	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
111	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
112	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
113	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
114	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
115	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
116	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
117	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
118	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
119	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
120	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
121	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	12,691,325.50	0.29
2	688099	晶晨股份	9,605,283.30	0.22
3	000895	双汇发展	8,811,872.85	0.20
4	600727	鲁北化工	7,999,999.33	0.18
5	603229	奥翔药业	7,999,994.90	0.18
6	002044	美年健康	7,999,620.94	0.18
7	603816	顾家家居	7,832,374.00	0.18
8	000785	居然之家	6,999,997.06	0.16
9	002891	中宠股份	6,999,975.00	0.16
10	600141	兴发集团	6,255,724.09	0.14
11	002415	海康威视	6,120,415.00	0.14
12	601166	兴业银行	6,001,483.00	0.14
13	000858	五粮液	5,984,786.36	0.14
14	000938	紫光股份	5,836,373.00	0.13
15	000338	潍柴动力	5,529,419.00	0.12
16	300629	新劲刚	5,400,002.78	0.12
17	002001	新和成	5,207,446.60	0.12
18	603486	科沃斯	5,184,000.00	0.12
19	300017	网宿科技	5,154,000.00	0.12
20	000333	美的集团	5,117,401.00	0.12

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	40,182,448.52	0.91
2	603486	科沃斯	16,197,336.22	0.37
3	300629	新劲刚	7,666,960.91	0.17
4	002044	美年健康	6,415,029.00	0.15
5	000338	潍柴动力	6,229,821.00	0.14
6	000333	美的集团	6,128,688.00	0.14
7	688180	君实生物	6,100,019.60	0.14
8	000858	五粮液	5,531,227.30	0.13
9	601899	紫金矿业	5,464,114.00	0.12
10	002624	完美世界	5,225,740.35	0.12
11	002415	海康威视	5,202,577.00	0.12
12	002064	华峰化学	5,049,931.00	0.11
13	000710	贝瑞基因	4,947,708.00	0.11
14	300999	金龙鱼	4,845,260.07	0.11
15	600036	招商银行	4,689,508.00	0.11
16	600309	万华化学	4,576,324.77	0.10
17	002001	新和成	4,502,918.00	0.10
18	601799	星宇股份	4,264,931.00	0.10
19	603305	旭升股份	4,248,455.18	0.10
20	600031	三一重工	4,241,766.00	0.10

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	398,351,172.89
卖出股票收入（成交）总额	273,969,929.69

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	23,054,989.50	0.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	196,398,131.06	4.44
	其中：政策性金融债	196,398,131.06	4.44
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）	69,631,822.14	1.57
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	289,084,942.70	6.53

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200403	20 农发 03	1,300,000	129,441,000.00	2.93
2	108604	国开 1805	466,182	47,005,131.06	1.06
3	019640	20 国债 10	230,850	23,054,989.50	0.52
4	200406	20 农发 06	200,000	19,952,000.00	0.45
5	113037	紫银转债	91,600	9,945,928.00	0.22

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：贵金属不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：权证不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项目不适用。

### 8.12 本报告期投资基金情况

#### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金为基金中基金，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理

和基金品种进行投资，力求基金资产的长期稳健增值。本基金主要投资于公开募集证券投资基金，且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%。本基金整体风险中等，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	163402	兴全趋势投资混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	215,091,504.40	215,285,086.75	4.87	是
2	163417	兴全合宜混合（LOF）A	上市契约型开放式（LOF）	77,858,912.15	152,385,462.86	3.44	是
3	163407	兴全沪深300指数（LOF）A	上市契约型开放式（LOF）	48,883,309.97	133,774,066.06	3.02	是
4	510900	H股ETF	交易型开放式（ETF）	112,285,300.00	130,587,803.90	2.95	否
5	163415	兴全商业模式混合（LOF）	上市契约型开放式（LOF）	33,764,245.93	126,615,922.24	2.86	是

6	510050	50ETF	交易 型开 放式	34,426,600.00	125,106,264.40	2.83	否
7	340007	兴全社会责 任混合	契约 型开 放式	19,797,765.40	117,380,951.06	2.65	是
8	510300	300ETF	交易 型开 放式	21,713,700.00	114,800,331.90	2.59	否
9	100032	富国中证红 利指数增强	契约 型开 放式	94,747,258.99	106,685,413.62	2.41	否
10	003949	兴全稳泰债 券 A	契约 型开 放式	102,063,135.97	106,584,532.89	2.41	是
11	000628	大成高新技 术产业股票 A	契约 型开 放式	33,537,050.99	106,312,451.64	2.40	否
12	163412	兴全轻资产 混合(LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	28,817,038.31	100,946,085.20	2.28	是
13	340006	兴全全球视 野股票	契约 型开 放式	34,441,528.33	100,248,956.51	2.27	是
14	260116	景顺长城核 心竞争力混 合 A 类	契约 型开 放式	19,859,185.93	92,583,524.81	2.09	否
15	163409	兴全绿色投 资混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	48,085,354.07	92,131,538.40	2.08	是
16	166001	中欧新趋势 混合(LOF)A	上市 契约	41,863,311.41	80,260,340.64	1.81	否

			型开 放式 (LOF)				
17	166005	中欧价值发 现混合 A	契约 型开 放式	41,422,729.65	79,825,742.31	1.80	否
18	169101	东方红睿丰 混合	契约 型开 放式	31,293,552.67	78,202,588.12	1.77	否
19	001256	泓德优选成 长混合	契约 型开 放式	45,289,185.38	78,078,555.60	1.76	否
20	166009	中欧新动力 混合(LOF)A	契约 型上 市开 放式 (LOF)	22,562,814.12	77,670,231.33	1.76	否
21	168103	九泰锐益	上市 契约 型开 放式 (LOF)	45,204,892.00	76,893,521.29	1.74	否
22	000020	景顺长城品 质投资混合	契约 型开 放式	18,270,209.43	75,784,828.72	1.71	否
23	159920	恒生 ETF	交易 型开 放式	51,457,747.00	73,636,035.96	1.66	否
24	160613	鹏华盛世创 新混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	41,353,540.38	71,665,685.48	1.62	否
25	206002	鹏华精选成 长混合	契约 型开 放式	24,768,041.82	68,607,475.84	1.55	否

26	001975	景顺长城环 保优势股票	契约 型开 放式	18,458,872.16	61,966,433.84	1.40	否
27	518880	黄金 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	15,387,000.00	59,239,950.00	1.34	否
28	161017	富国中证 500 指数增 强(LOF)	契约 型开 放式	26,442,162.16	58,225,641.08	1.32	否
29	001409	工银互联网 加股票	契约 型开 放式	84,528,690.34	57,817,624.19	1.31	否
30	163411	兴全精选混 合	契约 型开 放式	15,399,092.89	56,360,679.98	1.27	是
31	161131	易基配售	契约 型开 放式	50,068,943.00	55,175,975.19	1.25	否
32	070019	嘉实价值优 势混合	契约 型开 放式	19,778,933.66	48,339,713.87	1.09	否
33	160142	南方配售	上市 型开 放式 (LOF)	41,441,751.00	45,958,901.86	1.04	否
34	003143	鹏华弘达混 合 C	契约 型开 放式	32,417,537.89	41,500,932.01	0.94	否
35	002015	南方荣光灵 活配置混合 A	契约 型开 放式	28,409,019.88	40,369,217.25	0.91	否
36	340009	兴全磐稳债 券 A	契约 型开 放式	27,954,434.27	39,667,342.23	0.90	是
37	004958	圆信永丰优	契约	16,919,473.59	36,224,592.96	0.82	否

		享生活	型开 放式				
38	005062	博时中证 500 指数增 强 A	契约 型开 放式	25,966,091.80	35,820,223.64	0.81	否
39	240022	华宝资源优 选混合 A	契约 型开 放式	14,455,719.83	35,763,450.86	0.81	否
40	005937	工银精选金 融地产混合 A	契约 型开 放式	23,360,553.48	34,440,464.00	0.78	否
41	001328	鹏华弘华混 合 C	契约 型开 放式	25,260,188.62	31,049,823.85	0.70	否
42	007130	中庚小盘价 值股票	契约 型开 放式	21,745,963.35	30,535,681.74	0.69	否
43	001330	鹏华弘实混 合 C	契约 型开 放式	20,078,770.56	29,417,406.75	0.66	否
44	501186	华夏配售	契约 型开 放式	27,312,374.00	29,033,053.56	0.66	否
45	512090	MSCI 易基	交易 型开 放式	16,278,100.00	27,672,770.00	0.63	否
46	001835	易方达瑞祥 混合 I	契约 型开 放式	20,490,983.61	27,089,080.33	0.61	否
47	161125	易标普 500 指数 (QDII-LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	16,558,205.00	25,335,709.47	0.57	否
48	501076	科创基金	上市 契约	14,892,490.00	21,996,207.73	0.50	否

			型开 放式 (LOF)				
49	090013	大成竞争优 势混合	契约 型开 放式	16,569,179.78	20,976,581.60	0.47	否
50	168105	九泰泰富	契约 型	11,533,271.00	19,883,359.20	0.45	否
51	501085	财通科创主 题3年封闭 运作灵活配 置混合	契约 型开 放式	14,557,554.00	19,478,007.25	0.44	否
52	511880	银华日利	契约 型开 放式	186,100.00	18,635,123.50	0.42	否
53	161728	招商配售	契约 型开 放式	14,216,298.00	15,836,955.97	0.36	否
54	110023	易方达医疗 保健行业混 合	契约 型开 放式	4,127,678.00	15,833,772.81	0.36	否
55	510100	易方达上证 50ETF	交易 型开 放式 (ETF)	11,133,000.00	15,552,801.00	0.35	否
56	501073	科创混合	契约 型开 放式	14,255,305.00	15,509,771.84	0.35	否
57	501075	科创主题	上市 契约 型开 放式 (LOF)	8,054,894.00	12,485,085.70	0.28	否
58	168102	九泰锐富	契约 型	7,439,773.00	11,219,177.68	0.25	否
59	501081	中欧科创主	上市	7,255,252.00	11,216,619.59	0.25	否

		题 3 年封闭 运作灵活配 置混合	契约 型开 放式 (LOF)				
60	000083	汇添富消费 行业混合	契约 型开 放式	910,099.51	7,648,476.28	0.17	否
61	169106	东证创优	契约 定期 开放 式	6,343,012.00	6,748,964.77	0.15	否
62	001285	易方达新鑫 混合 I	契约 型开 放式	4,114,403.29	5,447,469.96	0.12	否
63	001817	易方达瑞兴 混合 I	契约 型开 放式	4,236,440.68	5,435,353.39	0.12	否
64	501080	中金科创主 题	上市 契约 型开 放式 (LOF)	3,558,320.00	5,376,621.52	0.12	否
65	501188	添富配售	契约 型开 放式	3,910,199.00	4,571,022.63	0.10	否
66	501062	南方瑞合	契约 型开 放式	3,151,788.00	4,166,663.74	0.09	否
67	501189	嘉实配售	契约 型开 放式	2,781,503.00	3,195,946.95	0.07	否
68	511990	华宝添益 ETF	契约 型开 放式	31,143.00	3,114,736.00	0.07	否
69	501054	东证睿泽	契约 型、定	1,731,875.00	3,084,469.38	0.07	否

			期开 放式 (LOF)				
70	515080	招商中证红利 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	2,262,200.00	2,787,030.40	0.06	否
71	512990	华夏 MSCI 中国 A 股国际通 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	1,194,000.00	2,110,992.00	0.05	否
72	161911	万家强债	契约 型开 放式	1,873,656.00	1,849,298.47	0.04	否
73	501063	添富悦享	契约 型开 放式	1,036,700.00	1,150,737.00	0.03	否
74	501079	大成科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合	契约 型开 放式	607,200.00	1,142,750.40	0.03	否
75	163412	兴全轻资产混合 (LOF)	上市 契约 型开 放式 (LOF)	68,919.00	237,150.28	0.01	是
76	166025	中欧远见两年定期开放混合	定期 开放 式 (LOF)	24,700.00	39,643.50	0.00	否

### 8.13 投资组合报告附注

#### 8.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

### 8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 8.13.3 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	164,281.15
2	应收证券清算款	48,876,290.80
3	应收股利	1,291,189.10
4	应收利息	2,218,884.88
5	应收申购款	21,508,507.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,059,153.83

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132018	G 三峡 EB1	9,474,280.20	0.21
2	110043	无锡转债	8,015,292.60	0.18
3	110059	浦发转债	7,744,944.00	0.18
4	127005	长证转债	7,028,462.50	0.16
5	113011	光大转债	4,955,200.00	0.11
6	110053	苏银转债	4,876,030.40	0.11
7	110047	山鹰转债	4,768,891.20	0.11
8	113026	核能转债	2,144,723.40	0.05
9	110051	中天转债	1,485,730.40	0.03
10	128032	双环转债	1,122,443.50	0.03
11	128063	未来转债	989,970.40	0.02
12	110064	建工转债	939,034.20	0.02
13	128048	张行转债	424,728.00	0.01
14	128100	搜特转债	76,832.40	0.00
15	113508	新风转债	71,347.50	0.00

### 8.13.5 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	002891	中宠股份	10,195,696.92	0.23	非公开流通受限
2	603229	奥翔药业	9,694,418.15	0.22	非公开流通受限

					限
3	600727	鲁北化工	8,697,899.11	0.20	非公开流通受限
4	688099	晶晨股份	8,146,600.00	0.18	大宗交易流通受限
5	000785	居然之家	7,902,262.97	0.18	非公开流通受限
6	688122	西部超导	7,577,729.88	0.17	询价转让流通受限
7	600141	兴发集团	7,227,756.69	0.16	非公开流通受限
8	000895	双汇发展	6,558,046.69	0.15	非公开流通受限
9	600095	湘财股份	5,968,049.85	0.13	非公开流通受限
10	603816	顾家家居	5,533,600.00	0.13	大宗交易流通受限

### 8.13.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
77,008	41,722.15	230,596,355.99	7.18	2,982,342,931.61	92.82

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	7,533,175.30	0.2345

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 3 月 6 日）基金份额总额	1,978,308,637.71
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,793,687,830.23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,559,057,180.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,212,939,287.60

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内本基金基金管理人重大人事变动。

2020 年 11 月 12 日公告，自 2020 年 11 月 10 日起，公司董事长及法定代表人由兰荣变更为杨华辉。

(2) 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金持有的九泰锐智定增灵活配置混合型证券投资基金，按照基金合同约定自 2020 年 8 月 14 日起自动转型为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“九泰锐智事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”。

本基金持有的大成高新技术股票型证券投资基金于 2020 年 12 月召开基金份额持有人大会，本次持有人大会审议的事项为修改该基金的基金合同，主要修改的内容为：增加港股通投资范围，并相应增加释义、投资限制、信息披露等内容；增加 C 类份额；调整业绩比较基准等。基金管理人代表本基金参与该基金基金份额持有人大会并对相关议案表决同意。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2020 年起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 5.5 万元人民币。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	3	398,183,662.51	75.67%	272,471.43	69.42%	-
国泰君安	1	107,712,768.54	20.47%	100,572.42	25.62%	-
中金公司	1	20,324,262.32	3.86%	19,478.37	4.96%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

#### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	129,583,506.37	82.67%	600,000,000.00	100.00%	-	-	1,752,375,539.48	92.28%
国泰君安	2,634,118.80	1.68%	-	-	-	-	41,704,529.13	2.20%
中金公司	24,525,086.50	15.65%	-	-	-	-	104,958,949.36	5.53%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-11
2	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-11
3	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-11
4	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）份额发售公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-11
5	关于增加兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-22
6	关于开展兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）网上直销认购费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-26
7	关于增加兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-27
8	关于增加兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-02-29
9	关于兴全优选进取三个月持有期混合	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-02

	型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	网网站	
10	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）认购申请确认比例结果的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-03
11	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-07
12	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）可投资科创板股票及相关风险揭示的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-17
13	关于公司法定名称变更的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-19
14	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）参加部分销售机构申购费率、定投费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-19
15	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购（含定期定额投资）业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-19
16	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	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-20
17	关于调整网上直销汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-03-26
18	关于增加腾安基金销售为兴全优选进取三个月持有期 FOF 销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-04-07
19	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	中国证券报、指定互联网网站	2020-05-12
20	关于旗下部分基金投资国网英大（600517）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-05-21
21	关于变更网上直销汇款交易账户的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-05-22
22	关于变更直销中心银行账户信息的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-05-25
23	关于旗下部分基金投资新劲刚（300629）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-05-26
24	兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常赎回业务的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-03
25	关于旗下部分基金投资汇纳科技（300609）非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-05
26	关于增加中信证券华南为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-10
27	关于旗下部分基金投资大千生态	中国证券报、指定互联	2020-06-11

	(603955)非公开发行股票的公告	网网站	
28	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-12
29	关于旗下部分基金投资旭升股份(603305)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-13
30	关于调整网上直销基金转换、赎回申购、汇款交易优惠费率的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-19
31	关于增加兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-06-19
32	关于增加财通证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-07-09
33	关于增加民商基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-07-09
34	关于调整旗下基金在光大证券以及安信证券费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-07-14
35	关于增加国金证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-07-30
36	关于旗下部分基金投资哈高科(600095)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-08-12
37	关于旗下基金参加民生银行费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-08-17
38	关于旗下部分基金投资哈工智能(000584)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-08-18
39	关于增加旗下兴全优选进取 FOF 销售机构的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-01
40	关于旗下部分基金投资精工钢构(600496)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-03
41	关于旗下部分基金投资数字政通(300075)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-04
42	关于旗下部分基金投资深天马A(000050)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-10
43	关于旗下部分基金投资可立克(002782)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-18
44	关于旗下部分基金投资天下秀(600556)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-22
45	关于旗下部分基金投资鲁北化工(600727)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-09-29
46	关于调整旗下基金在中国建设银行费率优惠活动的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-10-12
47	关于旗下部分基金投资双汇发展(000895)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-10-20
48	关于旗下部分基金投资中宠股份(002891)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-10-31
49	关于增加东北证券为旗下部分基金销	中国证券报、指定互联	2020-11-09

	售机构的公告	网网站	
50	董事长及法定代表人变更的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-11-11
51	关于董事会成员换届变更的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-11-11
52	关于旗下部分基金投资兴发集团(600141)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-11-26
53	关于旗下部分基金投资居然之家(000785)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-12-03
54	关于兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金基金经理变更的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-12-09
55	关于旗下部分基金投资奥翔药业(603229)非公开发行股票的公告	中国证券报、指定互联网网站	2020-12-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况,故不涉及本项特有风险。							

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复

- 2、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》
- 3、《兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）的法律意见书
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2021年3月31日