

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） 2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 21 日

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年07月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年04月01日起至06月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	兴全安泰积极养老五年持有混合发起式 FOF
基金主代码	010267
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月16日
报告期末基金份额总额	988,724,961.60份
投资目标	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。
投资策略	作为一只服务于投资者养老需求的基金，本基金定位为积极型的目标风险策略基金，根据特定的风险偏好设定权益类和固定收益类资产的比例，以获取养老资金的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×70%+中债综合（全价）指数收益率×30%
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、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。
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

注：本基金每份基金份额的最短持有期限为5年。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年4月1日-2021年6月30日）
1. 本期已实现收益	5,824,681.82
2. 本期利润	39,743,272.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0405
4. 期末基金资产净值	1,052,708,501.01
5. 期末基金份额净值	1.0647

注：1、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。

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

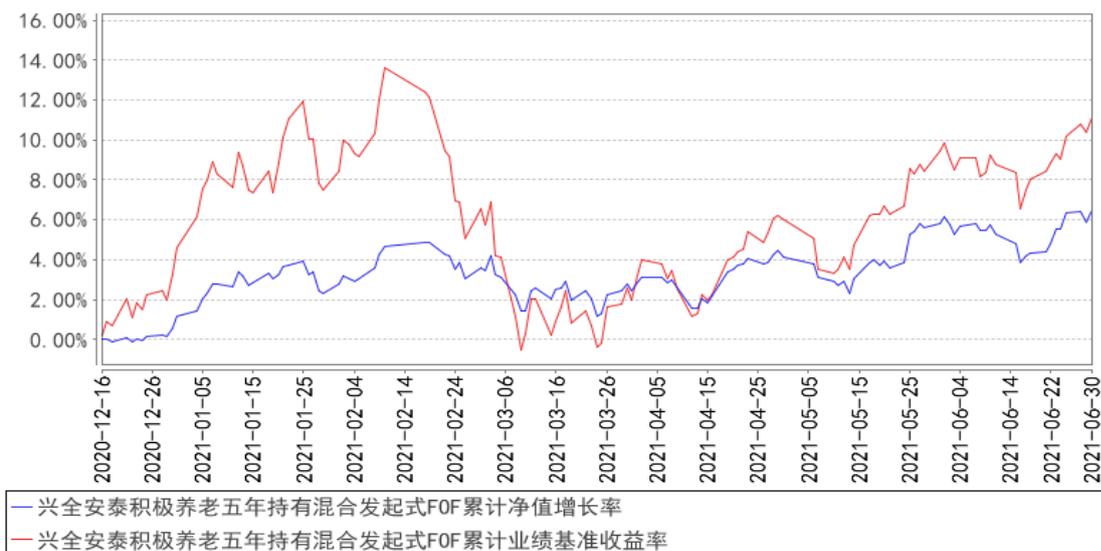
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	3.94%	0.45%	8.98%	0.73%	-5.04%	-0.28%
过去六个月	5.27%	0.47%	6.23%	1.00%	-0.96%	-0.53%
自基金合同 生效起至今	6.47%	0.45%	11.12%	0.98%	-4.65%	-0.53%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

兴全安泰积极养老五年持有混合发起式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2021年06月30日。

2、按照《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）基金合同》的规定，本基金建仓期为2020年12月16日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、本基金成立于2020年12月16日，截至2021年06月30日，本基金成立不满一年。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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，兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、	2020年12月16日	-	14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。

	兴全优选 进取三个 月持有期 混合型基 金中基金 （FOF）、 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） 基金经理				
--	--	--	--	--	--

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

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

3、证券从业的涵义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩

评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在不公平的因素。本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度在创业板、新能源板块的带动下，市场再次上扬。从全季来看，创业板指表现突出，上涨幅度达 26.05%，中证 1000 指数上涨 12.56%，上证综指上涨 4.34%，上证 50 指数则下跌 1.15%。从行业上来看，与新能源车产业链相关的板块大幅上涨，包括电气设备、电子、汽车行业的涨幅都超越或接近 20%，而家用电器、农林牧渔、房地产等行业跌幅领先。基金指数上，中证偏股基金指数全季上涨 12.75%，中长期纯债基金指数上涨 1.12%，黄金 ETF 上涨 2.55%。

本季度末，本基金的权益资产仓位已处于合同约定范围之内。由于市场经历快速的下跌后又迅速反弹，估值分化仍然严重，所以本基金继续保持中性偏保守的策略，基金仓位将坚持“越跌越买”的方式，前期建仓主要以价值型、GARP 型的权益基金以及偏绝对收益的基金品种为主，同时积极挖掘市场上绝对收益和相对收益的投资机会。未来随着市场逐渐趋于理性，本基金也将逐步的将组合调整到一贯的思路和策略。

本基金是一只积极型的养老目标基金，权益资产的中枢仓位是 70%，我们将秉承勤勉尽责的态度进行组合管理，为持有人争取更高的投资回报和养老储备。

4.5 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 1.0647 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.94%，业绩比较基准收益率为 8.98%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，截至报告期末成立不满三年，本项不适用。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	146,259,562.85	13.88
	其中：股票	146,259,562.85	13.88
2	基金投资	882,958,539.82	83.81
3	固定收益投资	1,625,784.18	0.15
	其中：债券	1,625,784.18	0.15
	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	21,854,277.04	2.07
8	其他资产	812,354.80	0.08
9	合计	1,053,510,518.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	11,290.28	0.00
B	采矿业	3,179,817.00	0.30
C	制造业	91,861,398.27	8.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,214,166.00	0.12
E	建筑业	1,004,719.44	0.10
F	批发和零售业	754,553.22	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,036,490.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,687,346.26	0.73
J	金融业	22,314,214.10	2.12
K	房地产业	8,852,206.00	0.84
L	租赁和商务服务业	1,848,124.00	0.18
M	科学研究和技术服务业	1,634,799.60	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	845,408.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	3,976,000.00	0.38
S	综合	-	-

合计	146,259,562.85	13.89
----	----------------	-------

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	111,300	7,154,364.00	0.68
2	002415	海康威视	102,625	6,619,312.50	0.63
3	600036	招商银行	86,900	4,709,111.00	0.45
4	002139	拓邦股份	263,158	4,310,528.04	0.41
5	000002	万科A	163,000	3,881,030.00	0.37
6	300460	惠伦晶体	161,681	3,547,281.14	0.34
7	601658	邮储银行	683,700	3,432,174.00	0.33
8	002050	三花智控	134,300	3,220,514.00	0.31
9	601128	常熟银行	468,000	2,901,600.00	0.28
10	300760	迈瑞医疗	6,000	2,880,300.00	0.27

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,625,784.18	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,625,784.18	0.15

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110079	杭银转债	5,660	644,504.20	0.06
2	127017	万青转债	4,903	548,939.88	0.05
3	113050	南银转债	2,700	270,000.00	0.03

4	123107	温氏转债	1,510	162,340.10	0.02
---	--------	------	-------	------------	------

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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：无。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.10.3 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	179,818.01
2	应收证券清算款	594,002.83
3	应收股利	88.51
4	应收利息	2,836.61
5	应收申购款	35,594.74
6	其他应收款	14.10
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	812,354.80

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127017	万青转债	548,939.88	0.05

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002139	拓邦股份	4,310,528.04	0.41	非公开流通受限
2	300460	惠伦晶体	3,547,281.14	0.34	非公开流通受限

5.11.6 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。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	003949	兴全稳泰债券 A	契约型开放式	38,321,517.53	41,011,688.06	3.90	是

2	004933	招商丰拓 灵活混合 C	契约型开放 式	20,531,070.35	32,673,145.35	3.10	否
3	163417	兴全合宜 混合 A	上市契约型 开放式 (LOF)	15,502,822.00	32,241,218.91	3.06	是
4	003344	鹏华弘惠 混合 C	契约型开放 式	26,216,997.24	32,160,390.51	3.06	否
5	005141	华夏睿磐 泰荣混合 C	契约型开放 式	24,966,711.05	32,074,733.69	3.05	否
6	110037	易方达纯 债债券 A	契约型开放 式	27,722,767.36	30,661,380.70	2.91	否
7	040040	华安纯债 债券 A	契约型开放 式	28,437,104.36	30,592,636.87	2.91	否
8	000186	华泰柏瑞 季季红债 券	契约型开放 式	28,915,662.65	30,477,108.43	2.90	否
9	163402	兴全趋势 投资混合 (LOF)	上市契约型 开放式 (LOF)	30,056,721.00	30,008,630.25	2.85	是
10	163415	兴全商业 模式混合 (LOF)	上市契约型 开放式 (LOF)	7,264,820.00	28,725,098.28	2.73	是

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021年4月1日至2021年6月30日	其中：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
当期交易基金产生的申购费（元）	11,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	137,109.28	22,992.49
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	101,331.30	41.86
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	1,856,334.05	400,894.31
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	348,365.81	73,807.84

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	975,406,379.35
报告期期间基金总申购份额	13,318,582.25
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	988,724,961.60

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

§ 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	30,005,600.53
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	30,005,600.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.03

注：买入/申购总份额含红利再投资、转换转入份额，卖出/赎回总份额含转换转出份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金管理人本报告期末运用固有资金对本基金进行交易。

§ 9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	30,005,600.53	3.03	30,005,600.53	3.03	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	30,005,600.53	3.03	30,005,600.53	3.03	-
----	---------------	------	---------------	------	---

§ 10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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
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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会关于准予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）注册的批复文件

2、《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）基金合同》

3、《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）托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会规定的其它文件

11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

11.3 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。

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 7 月 21 日