

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）	
基金简称	兴全沪深 300 指数（LOF）	
场内简称	兴全 300	
基金主代码	163407	
前端交易代码	163407	
后端交易代码	163408	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2010 年 11 月 2 日	
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,931,019,018.48 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011 年 1 月 19 日	
下属分级基金的基金简称	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C
下属分级基金的场内简称	兴全 300	无
下属分级基金的交易代码	163407	007230
下属分级基金的前端交易代码	163407	—
下属分级基金的后端交易代码	163408	—
报告期末下属分级	1,876,035,148.89 份	54,983,869.59 份

基金的份额总额		
---------	--	--

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额，仅 A 类份额上市交易。详情请见管理人网站公告。

2.2 基金产品说明

投资目标	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%。
投资策略	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。
业绩比较基准	沪深 300 指数×95%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证全球基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨卫东	秦一楠
	联系电话	021-20398888	010-66060069
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95599
传真		021-20398858	010-68121816
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号 凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		201204	100031
法定代表人		杨华辉	周慕冰

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算	A 类份额：北京市西城区太平

	有限责任公司 C 类份额：兴证全球基金管理 有限公司	桥大街 17 号 C 类份额：上海市浦东新区芳 甸路 1155 号嘉里城办公楼 28- 30 楼
--	----------------------------------	---

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)	
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C
本期已实现收益	173,590,608.63	4,117,826.47
本期利润	-107,196,455.13	-4,267,991.00
加权平均基金份 额本期利润	-0.0578	-0.0830
本期加权平均净 值利润率	-2.09%	-3.02%
本期基金份额净 值增长率	-2.48%	-2.67%
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	2,391,516,688.48	64,367,564.28
期末可供分配基 金份额利润	1.2748	1.1707
期末基金资产净 值	5,006,784,584.56	145,863,551.50
期末基金份额净 值	2.6688	2.6528
3.1.3 累计期末 指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	166.88%	44.79%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.02%	0.76%	-1.91%	0.76%	-2.11%	0.00%
过去三个月	-2.25%	0.97%	3.32%	0.93%	-5.57%	0.04%
过去六个月	-2.48%	1.25%	0.29%	1.25%	-2.77%	0.00%
过去一年	22.55%	1.29%	24.19%	1.27%	-1.64%	0.02%
过去三年	59.81%	1.29%	46.47%	1.30%	13.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	166.88%	1.36%	49.85%	1.36%	117.03%	0.00%

兴全沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.06%	0.76%	-1.91%	0.76%	-2.15%	0.00%
过去三个月	-2.35%	0.97%	3.32%	0.93%	-5.67%	0.04%

过去六个月	-2.67%	1.25%	0.29%	1.25%	-2.96%	0.00%
过去一年	22.06%	1.29%	24.19%	1.27%	-2.13%	0.02%
自基金合同生效 起至今	44.79%	1.21%	42.85%	1.21%	1.94%	0.00%

注：1、本基金为指数增强型证券投资基金，标的指数是沪深 300 指数，本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，按下列公式计算：

$$\text{Return}_t = 95\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

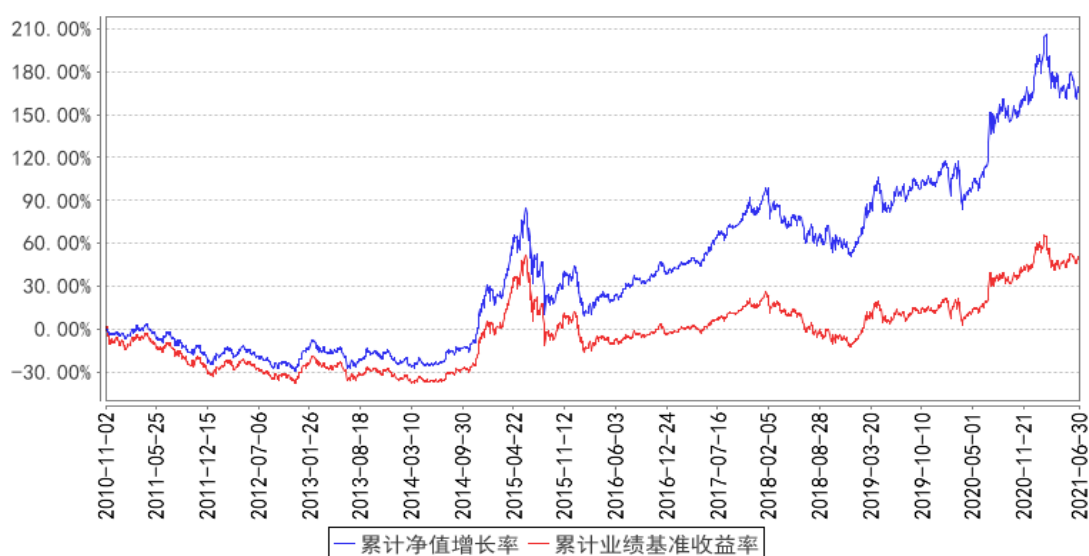
$$\text{Benchmark}_t = (1 + \text{Return}_t) \times (1 + \text{Benchmark}_{t-1}) - 1$$

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

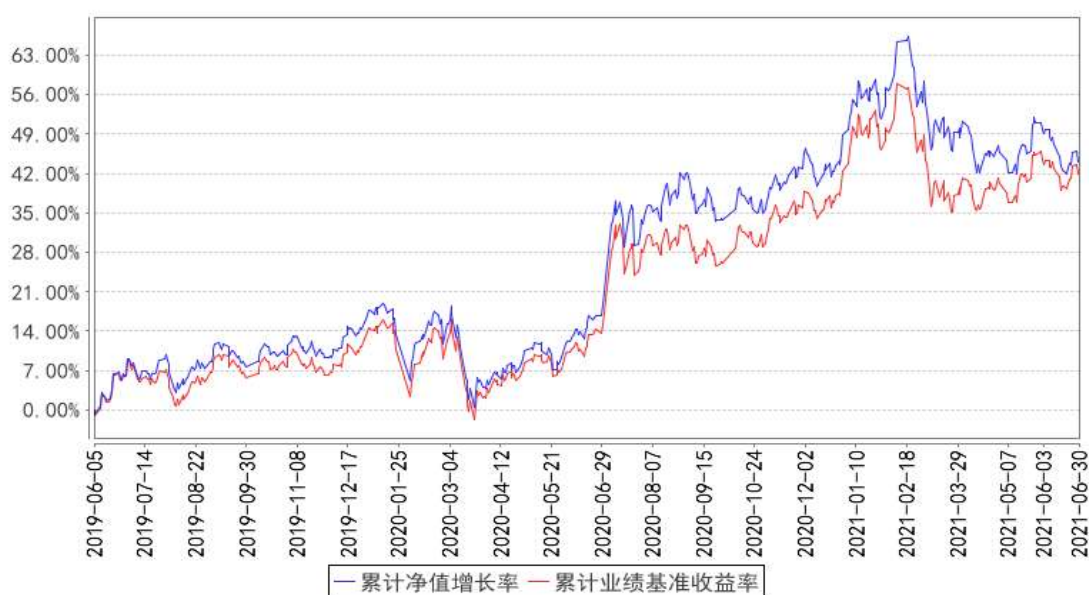
2、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

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

兴全沪深300指数（LOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴全沪深300指数C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 6 月 30 日。

2、按照《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 基金合同》的规定，本基金建仓期为 2010 年 11 月 2 日至 2011 年 5 月 1 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、经与基金托管人中国农业银行协商一致，并报中国证监会备案，管理人决定自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额（代码：007230）。详情请见管理人网站公告。

3.3 其他指标

注：无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为 1.5 亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016 年 12 月 28 日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020 年 3 月 18 日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共 42 只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF 等类型。

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		
申庆	兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理	2010 年 11 月 2 日	-	24 年	硕士，历任兴业证券研究发展中心研究员，兴证全球基金管理有限公司行业研究员，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理。
张 晓 峰	兴全中证 800 六个月持有期指数增强型证券投资基金基金经理助理、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理助理	2015 年 12 月 16 日	2021 年 5 月 13 日	10 年	硕士，历任兴证全球基金管理有限公司 FOF 投资与金融工程部研究员、固定收益部研究员。

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、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

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、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年以来极度分化的结构性行情使得以估值和价值为导向的指数增强投资成为一件富有挑战性的工作。上半年中证 100、沪深 300、中证 500、创业板指、科创 50 的涨幅分别为-2.85%、0.24%、6.93%、17.22%、14.01%，中小市值强于大市值，且新能源、医药、芯片等板块为代表的“宁”指数明显强于以金融、消费等传统稳定高 ROE 为特征的“茅”指数。根据我们的统计，主动型公募基金收益分布也呈现比较严重的尖峰、右偏特征。

虽然正如我们所预料的那样，春节前“茅”指数呈现明显泡沫化特征，忽略成长拉升估值并不具有可持续性，但二季度以来“宁”指数的异军突起却超出我们的预期。从近期市场特征看，单纯的质量因子已很难取得超额收益，相对而言成长性预期成为近期的主要矛盾，只有不断超预期

期的股票才能获得市场青睐，一旦低于预期很容易导致情绪逆转。

在具体操作上，我们依然坚持在保持总体行业和风格均衡的前提下，采取行业内相对综合价值比较的选股策略，并积极把握各种确定性的超额收益甚至绝对收益，从而尽可能在市场回落过程中降低整体组合的下方波动，同时又能在市场上升过程中紧跟市场。目前看这一策略面临逆风，我们根据市场投资逻辑的演化，虚心向市场学习，努力在风格上避免吃亏，但也不盲目追随热点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴全沪深 300 指数（LOF）A 的基金份额净值为 2.6688 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.48%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；截至本报告期末兴全沪深 300 指数 C 的基金份额净值为 2.6528 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.67%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮经济上行周期的可能已迎来拐点，下半年出口链、地产链动能可能减弱，稳增长压力逐渐上升，跨周期调整的应对措施也已在路上，7 月份超预期降准，且地方债发行节奏有望加快，财政对经济的托底功能有望加强。

目前市场状况与 2013 年既有相同之处，也有明显的不同。相同之处在于结构性行情鲜明，双创类股票显著跑赢大盘，而主流机构投资者并未充分从中受益，不同之处在于 2013 年的创业板更多的是小盘成长风格，与目前不乏千亿、万亿市值的双创权重股差异较大，且 2013 年无风险利率不断抬升，与目前的状况也明显不同。因此，不能简单将当前的结构性行情类比为 2013 年，尤其是不能忽略宏观背景。

我们坚持之前的判断，历史上任何时期的情绪化高估值品种都会向合理水平回归。从投资研究实践看，市场对较为长期的未来并无太强的预测能力，甚至连短期预测也倾向于线性外推。近期市场对“赛道”类资产的“终局”估值法应用达到极致，某些研究甚至采用几十年后的“终局”估值进行贴现，考虑到我国民营企业平均寿命以及新兴行业内在的技术迭代风险，至少对稳健型投资者而言很难作为合理的买入理由。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未实施利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生需披露的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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—兴证全球基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，兴证全球基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信

息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金本年度中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	3,374,555.44	363,031.95
结算备付金		7,037,442.72	11,464,041.04
存出保证金		281,320.05	604,180.11
交易性金融资产	6.4.7.2	5,375,688,746.85	5,816,601,142.73
其中：股票投资		4,896,600,676.78	5,352,995,578.31
基金投资		-	-
债券投资		479,088,070.07	463,605,564.42
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	2,000,000.00
应收证券清算款		9,580,340.76	58,264,095.25
应收利息	6.4.7.5	4,824,078.12	4,550,116.40
应收股利		-	-
应收申购款		11,054,133.72	10,782,525.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,411,840,617.66	5,904,629,132.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		219,399,837.25	284,999,499.50
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		34,812,014.67	35,581,742.10
应付管理人报酬		3,420,859.09	3,792,299.09

应付托管费		641,411.09	711,056.09
应付销售服务费		46,764.00	49,550.78
应付交易费用	6.4.7.7	206,257.48	480,605.47
应交税费		2,289.21	2,333.60
应付利息		56,632.99	80,702.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	606,415.82	505,019.22
负债合计		259,192,481.60	326,202,808.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,931,019,018.48	2,038,634,951.85
未分配利润	6.4.7.10	3,221,629,117.58	3,539,791,372.53
所有者权益合计		5,152,648,136.06	5,578,426,324.38
负债和所有者权益总计		5,411,840,617.66	5,904,629,132.60

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，兴全沪深 300 指数（LOF）A 基金份额净值 2.6688，基金份额总额 1,876,035,148.89 份；兴全沪深 300 指数 C 基金份额净值 2.6528，基金份额总额 54,983,869.59 份。兴全沪深 300 指数（LOF）份额总额合计为 1,931,019,018.48 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-81,372,615.40	203,428,528.45
1. 利息收入		4,158,827.73	4,975,087.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	100,984.61	147,161.07
债券利息收入		4,020,408.74	4,765,593.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37,434.38	62,333.34
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		200,746,526.14	165,149,335.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	153,840,124.84	95,619,621.50
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-6,183,401.26	1,189,843.90
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	53,089,802.56	68,339,870.12
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-289,172,881.23	28,775,869.11
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.18	2,894,911.96	4,528,236.39
减: 二、费用		30,091,830.73	31,685,783.19
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,961,142.51	21,399,829.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,930,214.27	4,012,468.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	280,419.82	255,407.43
4. 交易费用	6.4.7.19	1,744,512.74	3,455,007.29
5. 利息支出		2,632,481.40	2,006,373.48
其中: 卖出回购金融资产支出		2,632,481.40	2,006,373.48
6. 税金及附加		1,852.55	1,750.98
7. 其他费用	6.4.7.20	541,207.44	554,946.76
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-111,464,446.13	171,742,745.26
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-111,464,446.13	171,742,745.26

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,038,634,951.85	3,539,791,372.53	5,578,426,324.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-111,464,446.13	-111,464,446.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-107,615,933.37	-206,697,808.82	-314,313,742.19

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	794,880,363.37	1,418,020,441.84	2,212,900,805.21
2. 基金赎回款	-902,496,296.74	-1,624,718,250.66	-2,527,214,547.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,931,019,018.48	3,221,629,117.58	5,152,648,136.06
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,430,393,556.81	2,737,417,633.20	5,167,811,190.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	171,742,745.26	171,742,745.26
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)	-168,736,007.80	-245,587,767.15	-414,323,774.95
其中: 1. 基金申购款	1,761,752,777.80	1,801,806,042.61	3,563,558,820.41
2. 基金赎回款	-1,930,488,785.60	-2,047,393,809.76	-3,977,882,595.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,261,657,549.01	2,663,572,611.31	4,925,230,160.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)(原名兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF))(以下简称“本基金”),系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[2010]1068 号《关于核准兴业沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准,由兴全基金管理有限公司作为管理人向社会公开发行募集,基金合同于 2010 年 11 月 2 日正式生效,首次设立募集规模为 2,955,476,122.49 份基金份额。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为兴全基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2011 年 1 月 1 日起更名为兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)。自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)C 类份额,仅 A 类份额上市交易。

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%,其中,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。

本基金的业绩基准为:沪深 300 指数 $\times$ 95%+同业存款利率 $\times$ 5%。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作有关规

定的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	3,374,555.44
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	3,374,555.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,579,919,153.86	4,896,600,676.78	1,316,681,522.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	298,511,958.91	318,447,070.07
	银行间市场	160,487,554.50	160,641,000.00
	合计	458,999,513.41	479,088,070.07
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,038,918,667.27	5,375,688,746.85	1,336,770,079.58

6.4.7.3 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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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取得债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,185.21
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	3,166.80
应收债券利息	4,819,599.51
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	126.60
合计	4,824,078.12

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	203,137.37
银行间市场应付交易费用	3,120.11
合计	206,257.48

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	99,916.62
应付证券出借违约金	—

预提信息披露费	59,507.37
应付指数使用费	419,222.81
预提审计费	27,769.02
合计	606,415.82

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,992,371,296.24	1,992,371,296.24
本期申购	729,774,944.78	729,774,944.78
本期赎回 (以“-”号填列)	-846,111,092.13	-846,111,092.13
-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	1,876,035,148.89	1,876,035,148.89

兴全沪深 300 指数 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	46,263,655.61	46,263,655.61
本期申购	65,105,418.59	65,105,418.59
本期赎回 (以“-”号填列)	-56,385,204.61	-56,385,204.61
-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	54,983,869.59	54,983,869.59

注：1、申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴全沪深 300 指数 (LOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,356,610,993.62	1,103,346,824.98	3,459,957,818.60
本期利润	173,590,608.63	-280,787,063.76	-107,196,455.13
本期基金份额 交易产生的变动数	-138,684,913.77	-83,327,014.03	-222,011,927.80

其中：基金申购款	907,825,747.74	394,294,610.20	1,302,120,357.94
基金赎回款	-1,046,510,661.51	-477,621,624.23	-1,524,132,285.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,391,516,688.48	739,232,747.19	3,130,749,435.67

兴全沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	50,177,502.06	29,656,051.87	79,833,553.93
本期利润	4,117,826.47	-8,385,817.47	-4,267,991.00
本期基金份额交易产生的变动数	10,072,235.75	5,241,883.23	15,314,118.98
其中：基金申购款	74,371,405.00	41,528,678.90	115,900,083.90
基金赎回款	-64,299,169.25	-36,286,795.67	-100,585,964.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	64,367,564.28	26,512,117.63	90,879,681.91

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,377.30
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	72,450.54
其他	5,156.77
合计	100,984.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	153,840,124.84
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	153,840,124.84

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	821,161,940.62
减：卖出股票成本总额	667,321,815.78
买卖股票差价收入	153,840,124.84

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期末无股票出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,183,401.26
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	-6,183,401.26

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	238,244,644.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	240,505,002.20
减：应收利息总额	3,923,043.36
买卖债券差价收入	-6,183,401.26

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	53,089,802.56
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	53,089,802.56

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-289,172,881.23
股票投资	-295,892,136.81
债券投资	6,719,255.58
资产支持证券投资	—
基金投资	—
贵金属投资	—
其他	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-289,172,881.23

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,841,615.70
基金转换费收入	53,296.26
合计	2,894,911.96

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,740,862.74
银行间市场交易费用	3,650.00
合计	1,744,512.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	27,769.02
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
指数使用费	419,222.81
其他费用	600.00
银行费用	16,108.24
账户维护费用	18,000.00
合计	541,207.44

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表辅助中说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
兴证全球基金管理有限公司（“兴证全球基金”）	基金管理人、基金销售机构、本基金 C 类份额注册登记机构
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）

兴业证券	1,087,876,555.40	100.00	2,516,613,240.19	100.00
------	------------------	--------	------------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
兴业证券	69,043,234.37	100.00	38,979,423.55	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
兴业证券	9,350,091,000.00	100.00	8,484,365,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	796,583.35	100.00	203,137.37	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
兴业证券	1,847,587.94	100.00	940,855.64	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供

的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,961,142.51	21,399,829.24
其中：支付销售机构的客户维护费	5,917,455.60	5,423,225.59

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.8% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.8%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,930,214.27	4,012,468.01

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴证全球基金	—	18,969.76	18,969.76
合计	—	18,969.76	18,969.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	兴全沪深 300 指数 (LOF) A	兴全沪深 300 指数 C	合计
兴证全球基金	-	71,822.72	71,822.72
合计	-	71,822.72	71,822.72

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本报告期内本基金的 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的 C 类基金份额销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×年销售服务费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度可比期间末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	3,374,555.44	23,377.30	2,561,022.99	61,331.67

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金报告内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000723	美锦能源	2021 年 1 月 28 日	2021 年 08 月 04 日	非公开发行流通受限	5.60	7.33	2,821,428	15,799,996.80	20,681,067.24	-
000927	中国铁物	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 8 日	非公开发行流通受限	3.29	3.67	1,063,830	3,500,000.70	3,904,256.10	注 1
002044	美年健康	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 15 日	大宗交易购入流通受限	12.49	8.95	700,000	8,743,000.00	6,265,000.00	-
002182	云海金属	2021 年 3 月 26 日	2021 年 9 月 27 日	大宗交易购入流通受限	8.91	11.54	230,000	2,049,300.00	2,654,200.00	-
002405	四维	2021	2021	非公	12.50	14.07	240,000	3,000,000.00	3,376,800.00	-

	图新	年 2 月 23 日	年 08 月 26 日	开发 行流 通受 限						
002558	巨人 网络	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 22 日	大宗 交易 购入 流通 受限	13.10	12.82	910,000	11,921,000.00	11,666,200.00	-
002558	巨人 网络	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 21 日	大宗 交易 购入 流通 受限	12.83	12.61	890,000	11,418,700.00	11,222,900.00	-
002562	兄弟 科技	2021 年 1 月 5 日	2021 年 7 月 8 日	非公 开发 行流 通受 限	4.71	4.17	1,486,200	7,000,002.00	6,197,454.00	-
002786	银宝 山新	2021 年 4 月 13 日	2021 年 10 月 15 日	非公 开发 行流 通受 限	4.73	6.75	1,099,366	5,200,001.18	7,420,720.50	-
300123	亚光 科技	2021 年 2 月 26 日	2021 年 8 月 26 日	大宗 交易 购入 流通 受限	8.98	10.47	1,000,000	8,980,000.00	10,470,000.00	-
300123	亚光 科技	2021 年 3 月 1 日	2021 年 9 月 1 日	大宗 交易 购入 流通 受限	8.98	10.44	888,800	7,981,424.00	9,279,072.00	-
300123	亚光 科技	2021 年 3 月 26 日	2021 年 9 月 27 日	大宗 交易 购入 流通 受限	7.87	10.40	700,000	5,509,000.00	7,280,000.00	-
300292	吴通 控股	2021 年 5 月 24 日	2021 年 11 月 26 日	非公 开发 行流 通受 限	2.69	3.71	1,933,085	5,199,998.65	7,171,745.35	-

300439	美康生物	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 8 日	非公开发行流通受限	15.00	18.52	133,333	1,999,995.00	2,469,327.16	-
300444	双杰电气	2021 年 2 月 26 日	2021 年 9 月 1 日	非公开发行流通受限	4.30	6.02	697,674	2,999,998.20	4,199,997.48	-
300460	惠伦晶体	2021 年 5 月 7 日	2021 年 11 月 12 日	非公开发行流通受限	12.37	21.94	161,681	1,999,993.97	3,547,281.14	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300634	彩讯股份	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 15 日	非公开发行流通受限	11.46	19.58	261,780	2,999,998.80	5,125,652.40	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 07 月 12 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
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	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 07 月 21 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-

300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限	13.00	27.42	216	2,808.00	5,922.72	-
300948	冠中生态	2021 年 6 月 4 日	2021 年 8 月 25 日	新股流通受限-转增	-	27.42	108	-	2,961.36	注 2
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股流通受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-

300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-

300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300985	致远新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股流通受限	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股流通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-

300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600059	古越龙山	2021 年 4 月 28 日	2021 年 10 月 26 日	非公开发行流通受限	9.31	12.15	322,234	2,999,998.54	3,915,143.10	-
600161	天坛生物	2021 年 4 月 26 日	2021 年 10 月 25 日	非公开发行流通受限	28.13	32.87	2,310,700	64,999,991.00	75,952,709.00	-
600446	金证股份	2021 年 3 月 29 日	2021 年 9 月 27 日	非公开发行流通受限	12.34	14.06	243,112	3,000,002.08	3,418,154.72	-
600584	长电科技	2021 年 4 月 29 日	2021 年 10 月 26 日	非公开发行流通受限	28.30	35.44	530,035	14,999,990.50	18,784,440.40	-
601360	三六零	2021 年 1 月 6 日	2021 年 07 月 09 日	非公开发行流通受限	12.93	12.11	2,060,000	26,635,800.00	24,946,600.00	-
601360	三六零	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 10 日	大宗交易购入	11.07	11.59	1,000,000	11,070,000.00	11,590,000.00	-

		日	日	流通 受限						
603703	盛洋科技	2021 年 1 月 5 日	2021 年 7 月 1 日	非公 开发 行流 通受 限	9.61	12.70	312,175	3,000,001.75	3,964,622.50	-
603799	华友钴业	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 9 日	非公 开发 行流 通受 限	84.00	108.54	452,381	38,000,004.00	49,101,433.74	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 流通 受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688083	中望软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股 流通 受限	150.50	524.08	1,837	276,468.50	962,734.96	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股 流通 受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688099	晶晨股份	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 6 日	大宗 交易 购入 流通 受限	78.58	106.02	27,300	2,145,234.00	2,894,346.00	-
688117	圣诺生物	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股 流通 受限	17.90	35.97	1,672	29,928.80	60,141.84	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688616	西力科技	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04	-
688633	星球石墨	2021 年 3 月 17	2021 年 9 月 24	新股 流通 受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-

		日	日							
688660	电气风电	2021 年 5 月 11 日	2021 年 11 月 19 日	新股流通受限	5.44	7.26	51,238	278,734.72	371,987.88	-
688819	天能股份	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 19 日	新股流通受限	41.79	43.69	28,382	1,186,083.78	1,240,009.58	-

6.4.12.1.2 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
113049	长汽转债	2021 年 6 月 11 日	2021 年 7 月 8 日	新发未上市	100.00	100.00	1,700	170,000.00	170,000.00	-
113050	南银转债	2021 年 6 月 16 日	2021 年 7 月 1 日	新发未上市	100.00	100.00	263,510	26,351,000.00	26,351,000.00	-
113050	南银转债	2021 年 06 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新发未上市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-

注：1、经深圳证券交易所核准，公司证券简称自 2021 年 1 月 8 日起由“一汽夏利”变更为“中国铁物”。

2、本基金持有的新股流通受限股票冠中生态，于 2021 年 6 月 4 日实施 2020 年年度权益分配方案，向全体股东每 10 股派发现金股利人民币 0.80 元（含税），同时，以资本公积金向全体股东每 10 股转增 5 股。本基金新增 108 股。

3、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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事项停牌	5.59	2021 年 7 月 6 日	6.15	288,077	3,433,056.43	1,610,350.43	-

					日					
--	--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末 2021 年 6 月 30 日, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 28,499,837.25 元, 是如下证券作为抵押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
160312	16 进出 12	2021 年 7 月 6 日	100.25	300,000	30,075,000.00
合计				300,000	30,075,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 190,900,000.00 元, 于 2021 年 7 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的证券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 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参加因转融通证券业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	180,420,476.68	130,675,956.02
AAA 以下	28,551,778.39	41,228,820.80
未评级	-	-
合计	208,972,255.07	171,904,776.82

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

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

本基金所持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

注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2021 年 6 月 30 日							
资产							
银行存款	3,374,555.44	-	-	-	-	-	3,374,555.44
结算备付金	7,037,442.72	-	-	-	-	-	7,037,442.72
存出保证金	281,320.05	-	-	-	-	-	281,320.05
交易性金融资产	77,390,000.00	14,278,475.00	178,447,340.00	166,961,622.41	42,010,632.66	4,896,600,676.78	5,375,688,746.85
应收利息	-	-	-	-	-	4,824,078.12	4,824,078.12
应收申购款	86,911.54	-	-	-	-	10,967,222.18	11,054,133.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,580,340.76	9,580,340.76
资产总计	88,170,229.75	14,278,475.00	178,447,340.00	166,961,622.41	42,010,632.66	4,921,972,317.84	5,411,840,617.66
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	34,812,014.67	34,812,014.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,420,859.09	3,420,859.09
应付托管费	-	-	-	-	-	641,411.09	641,411.09
卖出回购金融资产款	219,399,837.25	-	-	-	-	-	219,399,837.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	46,764.00	46,764.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	206,257.48	206,257.48
应付利息	-	-	-	-	-	56,632.99	56,632.99
应交税费	-	-	-	-	-	2,289.21	2,289.21
其他负债	-	-	-	-	-	606,415.82	606,415.82
负债总计	219,399,837.25	-	-	-	-	39,792,644.35	259,192,481.60
利率敏感度缺口	131,229,607.50	14,278,475.00	178,447,340.00	166,961,622.41	42,010,632.66	4,882,179,673.49	5,152,648,136.06
上年度末 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	363,031.95	-	-	-	-	-	363,031.95
结算备付金	11,464,041.04	-	-	-	-	-	11,464,041.04
存出保证金	604,180.11	-	-	-	-	-	604,180.11
交易性金融资产	20,498,950.00	130,119,919.60	141,081,918.00	157,724,254.49	14,180,522.33	5,352,995,578.31	5,816,601,142.73
买入返售金融资产	2,000,000.00	-	-	-	-	-	2,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	4,550,116.40	4,550,116.40
应收申购款	100,632.18	-	-	-	-	10,681,892.94	10,782,525.12
应收证券清算款	-	-	-	-	-	58,264,095.25	58,264,095.25
资产总计	35,030,835.28	130,119,919.60	141,081,918.00	157,724,254.49	14,180,522.33	5,426,491,682.90	5,904,629,132.60
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	35,581,742.10	35,581,742.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,792,299.09	3,792,299.09
应付托管费	-	-	-	-	-	711,056.09	711,056.09
卖出回购金融资产款	284,999,499.50	-	-	-	-	-	284,999,499.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	49,550.78	49,550.78
应付交易费用	-	-	-	-	-	480,605.47	480,605.47
应付利息	-	-	-	-	-	80,702.37	80,702.37
应交税费	-	-	-	-	-	2,333.60	2,333.60
其他负债	-	-	-	-	-	505,019.22	505,019.22
负债总计	284,999,499.50	-	-	-	-	41,203,308.72	326,202,808.22
利率敏感度缺口	-	130,119,919.60	141,081,918.00	157,724,254.49	14,180,522.33	5,385,288,374.18	5,578,426,324.38

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分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动；		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)。		
	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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
分析	利率+1%	-998,238.57	-1,002,072.64
	利率-1%	1,009,444.80	1,012,486.73

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例范围为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%,其中,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。本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产—股票投资	4,896,600,676.78	95.03	5,352,995,578.31	95.96
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	479,088,070.07	9.30	463,605,564.42	8.31
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	5,375,688,746.85	104.33	5,816,601,142.73	104.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	在业绩基准变化 10% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准+10%	511,332,534.12	574,665,666.93
	业绩比较基准-10%	-511,332,534.12	-574,665,666.93

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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	权益投资	4,896,600,676.78	90.48
	其中：股票	4,896,600,676.78	90.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	479,088,070.07	8.85
	其中：债券	479,088,070.07	8.85
	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	-	-
	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	10,411,998.16	0.19
8	其他各项资产	25,739,872.65	0.48
9	合计	5,411,840,617.66	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资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	1,670,656.20	0.03
B	采矿业	126,823,603.91	2.46
C	制造业	2,323,160,691.59	45.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,402,904.00	0.61
E	建筑业	24,532,219.00	0.48
F	批发和零售业	25,233,194.64	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	55,959,737.50	1.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	137,549,652.06	2.67
J	金融业	1,262,679,466.36	24.51
K	房地产业	102,053,459.89	1.98
L	租赁和商务服务业	396,113,257.66	7.69
M	科学研究和技术服务业	1,965,189.29	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	58,816,189.87	1.14
R	文化、体育和娱乐业	90,042,664.01	1.75
S	综合	—	—
	合计	4,638,002,885.98	90.01

7.2.2 报告期末积极投资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	19,224,352.34	0.37
C	制造业	173,481,731.78	3.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,662.00	0.00
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	4,609,236.46	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	3,904,256.10	0.08
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,307,716.57	0.51
J	金融业	12,080,812.50	0.23
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	18,962,718.33	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	258,597,790.80	5.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	601888	中国中免	1,301,805	390,671,680.50	7.58
2	600519	贵州茅台	133,800	275,186,460.00	5.34
3	000100	TCL 科技	31,388,800	240,124,320.00	4.66
4	601318	中国平安	3,128,863	201,123,313.64	3.90
5	000895	双汇发展	5,738,809	182,494,126.20	3.54
6	600036	招商银行	3,358,870	182,017,165.30	3.53
7	601601	中国太保	6,058,139	175,504,286.83	3.41
8	000858	五 粮 液	505,829	150,681,400.81	2.92
9	601009	南京银行	13,188,856	138,746,765.12	2.69
10	600741	华域汽车	4,587,800	120,521,506.00	2.34
11	601336	新华保险	2,500,880	114,815,400.80	2.23
12	600690	海尔智家	4,278,844	110,864,848.04	2.15
13	002773	康弘药业	4,188,835	96,887,753.55	1.88
14	300124	汇川技术	1,228,200	91,206,132.00	1.77
15	000938	紫光股份	3,818,838	83,556,175.44	1.62
16	601166	兴业银行	3,999,818	82,196,259.90	1.60
17	002739	万达电影	5,017,559	79,227,256.61	1.54
18	603799	华友钴业	688,577	76,075,016.94	1.48
19	600309	万华化学	698,059	75,962,780.38	1.47
20	600161	天坛生物	2,310,700	75,952,709.00	1.47
21	000001	平安银行	3,058,000	69,171,960.00	1.34
22	000333	美的集团	828,891	59,157,950.67	1.15
23	002044	美年健康	6,468,517	58,816,189.87	1.14
24	601398	工商银行	9,888,820	51,125,199.40	0.99
25	600276	恒瑞医药	682,019	46,356,831.43	0.90
26	601225	陕西煤业	3,888,007	46,072,882.95	0.89
27	002821	凯莱英	118,618	44,197,066.80	0.86
28	000568	泸州老窖	184,413	43,510,403.22	0.84
29	601628	中国人寿	1,228,978	41,650,064.42	0.81
30	000651	格力电器	776,191	40,439,551.10	0.78
31	002555	三七互娱	1,587,182	38,124,111.64	0.74
32	601899	紫金矿业	3,777,180	36,600,874.20	0.71
33	601360	三六零	3,060,000	36,536,600.00	0.71
34	601838	成都银行	2,828,900	35,757,296.00	0.69
35	600436	片仔癀	76,813	34,435,267.90	0.67
36	001979	招商蛇口	3,115,283	34,112,348.85	0.66
37	300450	先导智能	563,016	33,859,782.24	0.66

38	600196	复星医药	469,300	33,850,609.00	0.66
39	600000	浦发银行	3,228,900	32,289,000.00	0.63
40	002352	顺丰控股	463,536	31,381,387.20	0.61
41	000069	华侨城 A	4,188,800	31,164,672.00	0.60
42	002142	宁波银行	758,727	29,567,591.19	0.57
43	601012	隆基股份	296,447	26,336,351.48	0.51
44	600760	中航沈飞	436,100	26,296,830.00	0.51
45	000338	潍柴动力	1,432,100	25,591,627.00	0.50
46	601169	北京银行	5,198,800	25,318,156.00	0.49
47	601088	中国神华	1,273,808	24,864,732.16	0.48
48	000063	中兴通讯	708,800	23,553,424.00	0.46
49	002558	巨人网络	1,800,000	22,889,100.00	0.44
50	600406	国电南瑞	970,616	22,557,115.84	0.44
51	600019	宝钢股份	2,938,880	22,453,043.20	0.44
52	600585	海螺水泥	528,973	21,714,341.65	0.42
53	600383	金地集团	1,968,871	20,161,239.04	0.39
54	000157	中联重科	2,064,316	19,074,279.84	0.37
55	600016	民生银行	4,281,133	18,879,796.53	0.37
56	600584	长电科技	530,035	18,784,440.40	0.36
57	600660	福耀玻璃	316,300	17,665,355.00	0.34
58	601818	光大银行	4,518,800	17,081,064.00	0.33
59	600028	中国石化	3,831,685	16,706,146.60	0.32
60	600048	保利地产	1,380,000	16,615,200.00	0.32
61	600009	上海机场	338,800	16,306,444.00	0.32
62	601607	上海医药	703,306	14,860,855.78	0.29
63	601668	中国建筑	3,167,100	14,727,015.00	0.29
64	601985	中国核电	2,817,500	14,256,550.00	0.28
65	601939	建设银行	2,088,800	13,890,520.00	0.27
66	002624	完美世界	569,600	13,619,136.00	0.26
67	600893	航发动力	254,302	13,526,323.38	0.26
68	601633	长城汽车	296,900	12,941,871.00	0.25
69	002050	三花智控	508,400	12,191,432.00	0.24
70	601229	上海银行	1,419,836	11,642,655.20	0.23
71	000538	云南白药	96,723	11,192,785.56	0.22
72	300413	芒果超媒	157,659	10,815,407.40	0.21
73	002007	华兰生物	276,041	10,125,183.88	0.20
74	600795	国电电力	3,978,800	9,668,484.00	0.19
75	601600	中国铝业	1,787,800	9,475,340.00	0.18
76	601390	中国中铁	1,788,800	9,373,312.00	0.18
77	002601	龙佰集团	260,552	9,009,888.16	0.17
78	000768	中航西飞	340,700	8,953,596.00	0.17
79	600352	浙江龙盛	649,200	8,920,008.00	0.17

80	002008	大族激光	218,571	8,828,082.69	0.17
81	601877	正泰电器	252,100	8,415,098.00	0.16
82	002241	歌尔股份	183,799	7,855,569.26	0.15
83	002271	东方雨虹	136,150	7,531,818.00	0.15
84	000725	京东方 A	1,146,870	7,156,468.80	0.14
85	002594	比亚迪	27,448	6,889,448.00	0.13
86	600362	江西铜业	301,313	6,743,384.94	0.13
87	600085	同仁堂	148,700	6,074,395.00	0.12
88	000425	徐工机械	886,000	5,643,820.00	0.11
89	600655	豫园股份	486,668	5,640,482.12	0.11
90	600926	杭州银行	373,200	5,504,700.00	0.11
91	002027	分众传媒	578,276	5,441,577.16	0.11
92	002415	海康威视	80,000	5,160,000.00	0.10
93	603833	欧派家居	36,274	5,149,457.04	0.10
94	601138	工业富联	398,404	4,944,193.64	0.10
95	600030	中信证券	186,700	4,656,298.00	0.09
96	601021	春秋航空	80,487	4,579,710.30	0.09
97	601688	华泰证券	281,500	4,447,700.00	0.09
98	600118	中国卫星	143,403	4,195,971.78	0.08
99	600332	白云山	123,700	4,187,245.00	0.08
100	600886	国投电力	427,300	4,106,353.00	0.08
101	002252	上海莱士	515,500	3,861,095.00	0.07
102	600989	宝丰能源	267,900	3,664,872.00	0.07
103	600025	华能水电	582,300	3,371,517.00	0.07
104	601111	中国国航	373,900	2,908,942.00	0.06
105	300122	智飞生物	14,000	2,614,220.00	0.05
106	603993	洛阳钼业	499,800	2,578,968.00	0.05
107	000963	华东医药	47,205	2,171,902.05	0.04
108	002153	石基信息	91,840	2,159,158.40	0.04
109	002179	中航光电	27,210	2,150,134.20	0.04
110	000776	广发证券	132,300	2,003,022.00	0.04
111	601658	邮储银行	398,384	1,999,887.68	0.04
112	600104	上汽集团	86,200	1,893,814.00	0.04
113	600999	招商证券	96,242	1,830,522.84	0.04
114	600299	安迪苏	150,000	1,794,000.00	0.03
115	603259	药明康德	11,151	1,746,135.09	0.03
116	300498	温氏股份	116,260	1,670,656.20	0.03
117	600588	用友网络	50,043	1,664,430.18	0.03
118	002024	苏宁易购	288,077	1,610,350.43	0.03
119	300408	三环集团	29,585	1,254,995.70	0.02
120	601916	浙商银行	294,195	1,167,954.15	0.02
121	002236	大华股份	51,416	1,084,877.60	0.02

122	600111	北方稀土	49,600	1,026,720.00	0.02
123	601933	永辉超市	200,762	949,604.26	0.02
124	600031	三一重工	29,241	850,035.87	0.02
125	601816	京沪高铁	100,000	529,000.00	0.01
126	601669	中国电建	111,600	431,892.00	0.01
127	600438	通威股份	9,039	391,117.53	0.01
128	002938	鹏鼎控股	8,980	322,202.40	0.01
129	601878	浙商证券	22,392	292,887.36	0.01
130	002841	视源股份	2,134	265,234.86	0.01
131	600233	圆通速递	25,400	254,254.00	0.00
132	300676	华大基因	1,847	219,054.20	0.00
133	600521	华海药业	3,600	75,168.00	0.00
134	300433	蓝思科技	287	8,440.67	0.00
135	002916	深南电路	18	2,000.34	0.00

7.3.2 期末积极投资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	600195	中牧股份	3,888,885	46,511,064.60	0.90
2	300123	亚光科技	2,588,800	27,029,072.00	0.52
3	000723	美锦能源	2,821,428	20,681,067.24	0.40
4	300070	碧水源	2,588,000	18,918,280.00	0.37
5	601997	贵阳银行	1,682,415	12,046,091.40	0.23
6	600487	亨通光电	980,887	11,182,111.80	0.22
7	300254	仟源医药	1,531,800	10,937,052.00	0.21
8	000983	山西焦煤	1,288,000	10,703,280.00	0.21
9	002786	银宝山新	1,099,366	7,420,720.50	0.14
10	300292	吴通控股	1,933,085	7,171,745.35	0.14
11	601699	潞安环能	588,000	6,944,280.00	0.13
12	002562	兄弟科技	1,486,200	6,197,454.00	0.12
13	600141	兴发集团	288,000	5,423,040.00	0.11
14	300634	彩讯股份	261,780	5,125,652.40	0.10
15	600297	广汇汽车	1,570,350	4,522,608.00	0.09
16	300444	双杰电气	697,674	4,199,997.48	0.08
17	603703	盛洋科技	312,175	3,964,622.50	0.08
18	600059	古越龙山	322,234	3,915,143.10	0.08
19	000927	中国铁物	1,063,830	3,904,256.10	0.08
20	300460	惠伦晶体	161,681	3,547,281.14	0.07
21	000423	东阿阿胶	98,007	3,519,431.37	0.07
22	600446	金证股份	243,112	3,418,154.72	0.07
23	002405	四维图新	240,000	3,376,800.00	0.07
24	600271	航天信息	250,194	3,260,027.82	0.06

25	688099	晶晨股份	27,300	2,894,346.00	0.06
26	300609	汇纳科技	150,000	2,863,500.00	0.06
27	002182	云海金属	230,000	2,654,200.00	0.05
28	600727	鲁北化工	318,000	2,607,600.00	0.05
29	002422	科伦药业	128,000	2,553,600.00	0.05
30	300439	美康生物	133,333	2,469,327.16	0.05
31	300760	迈瑞医疗	4,800	2,304,240.00	0.04
32	600395	盘江股份	188,800	1,340,480.00	0.03
33	688819	天能股份	28,382	1,240,009.58	0.02
34	688083	中望软件	1,837	962,734.96	0.02
35	600718	东软集团	47,475	464,305.50	0.01
36	688660	电气风电	51,238	371,987.88	0.01
37	600985	淮北矿业	19,354	236,312.34	0.00
38	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
39	603156	养元饮品	6,813	194,715.54	0.00
40	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
41	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
42	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
43	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.00
44	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
45	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.00
46	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
47	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
48	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
49	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
50	002955	鸿合科技	1,884	35,965.56	0.00
51	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
52	300691	联合光电	2,069	32,752.27	0.00
53	603365	水星家纺	2,111	30,208.41	0.00
54	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
55	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
56	603773	沃格光电	881	23,231.97	0.00
57	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
58	603607	京华激光	1,439	20,923.06	0.00
59	002899	英派斯	1,408	18,599.68	0.00
60	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
61	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
62	603848	好太太	1,377	16,964.64	0.00
63	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
64	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
65	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
66	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
67	300937	药易购	244	13,105.24	0.00

68	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
69	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
70	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
71	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
72	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
73	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
74	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
75	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
76	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
77	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
78	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
79	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
80	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
81	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
82	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
83	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
84	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
85	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
86	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
87	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
88	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
89	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
90	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
91	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
92	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
93	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
94	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
95	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
96	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
97	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
98	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
99	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
100	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
101	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
102	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
103	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
104	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
105	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
106	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
107	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
108	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
109	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600161	天坛生物	64,999,991.00	1.17
2	603799	华友钴业	38,000,004.00	0.68
3	601360	三六零	37,705,800.00	0.68
4	002044	美年健康	32,192,432.19	0.58
5	002558	巨人网络	23,339,700.00	0.42
6	300123	亚光科技	22,470,424.00	0.40
7	600016	民生银行	21,046,937.69	0.38
8	601601	中国太保	19,688,058.91	0.35
9	601012	隆基股份	16,677,500.13	0.30
10	000723	美锦能源	15,799,996.80	0.28
11	600741	华域汽车	15,482,351.51	0.28
12	600584	长电科技	14,999,990.50	0.27
13	000895	双汇发展	13,850,344.74	0.25
14	002050	三花智控	11,103,664.74	0.20
15	601169	北京银行	10,190,175.00	0.18
16	600352	浙江龙盛	8,992,516.00	0.16
17	601318	中国平安	8,187,998.00	0.15
18	600519	贵州茅台	7,678,580.00	0.14
19	002562	兄弟科技	7,000,002.00	0.13
20	000938	紫光股份	6,969,089.00	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002558	巨人网络	55,527,222.05	1.00
2	603799	华友钴业	33,280,421.46	0.60
3	601318	中国平安	28,923,322.00	0.52
4	601601	中国太保	23,417,895.24	0.42
5	600900	长江电力	22,741,530.94	0.41
6	601012	隆基股份	22,065,872.24	0.40
7	600487	亨通光电	21,208,403.05	0.38
8	000063	中兴通讯	20,452,059.00	0.37
9	600104	上汽集团	20,076,908.00	0.36
10	600690	海尔智家	18,505,208.37	0.33
11	601988	中国银行	17,987,184.00	0.32
12	000895	双汇发展	17,122,812.05	0.31
13	600016	民生银行	16,879,047.82	0.30

14	601888	中国中免	16,259,934.22	0.29
15	601668	中国建筑	16,138,794.00	0.29
16	000938	紫光股份	15,353,027.91	0.28
17	600741	华域汽车	14,513,809.34	0.26
18	603156	养元饮品	14,296,292.02	0.26
19	601328	交通银行	14,153,225.00	0.25
20	600519	贵州茅台	14,127,447.00	0.25

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	506,819,051.06
卖出股票收入（成交）总额	821,161,940.62

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	125,229,340.00	2.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	144,886,475.00	2.81
	其中：政策性金融债	144,886,475.00	2.81
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）	208,972,255.07	4.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	479,088,070.07	9.30

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019640	20 国债 10	673,900	67,390,000.00	1.31
2	160312	16 进出 12	600,000	60,150,000.00	1.17
3	132018	G 三峡 EB1	378,880	45,511,065.60	0.88
4	102101	国债 2101	300,000	30,021,000.00	0.58
5	113050	南银转债	272,230	27,223,000.00	0.53

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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中，贵州茅台酒股份有限公司、中国平安保险（集团）股份有限公司、招商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	281,320.05
2	应收证券清算款	9,580,340.76
3	应收股利	—
4	应收利息	4,824,078.12
5	应收申购款	11,054,133.72
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	25,739,872.65

7.12.4 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	45,511,065.60	0.88
2	132020	19 蓝星 EB	23,424,043.20	0.45
3	110059	浦发转债	20,739,002.10	0.40
4	110051	中天转债	17,833,099.00	0.35
5	132014	18 中化 EB	13,840,216.80	0.27
6	132015	18 中油 EB	13,004,155.00	0.25
7	110061	川投转债	8,013,968.20	0.16
8	113044	大秦转债	5,928,645.10	0.12
9	110045	海澜转债	2,232,600.00	0.04
10	113525	台华转债	2,143,843.20	0.04
11	110041	蒙电转债	2,107,200.00	0.04
12	113026	核能转债	1,683,221.60	0.03
13	113021	中信转债	1,618,388.10	0.03
14	113537	文灿转债	1,356,450.20	0.03
15	110053	苏银转债	1,277,920.80	0.02
16	110062	烽火转债	1,271,719.00	0.02
17	132021	19 中电 EB	1,229,774.70	0.02
18	113011	光大转债	1,207,811.00	0.02
19	127012	招路转债	893,700.50	0.02
20	128022	众信转债	844,000.00	0.02
21	127005	长证转债	726,268.00	0.01
22	110057	现代转债	533,333.70	0.01
23	127015	希望转债	524,064.60	0.01
24	113534	鼎胜转债	417,622.40	0.01
25	113027	华钰转债	404,933.40	0.01
26	127020	中金转债	403,696.00	0.01
27	128057	博彦转债	315,289.60	0.01
28	128081	海亮转债	256,984.60	0.00

29	127006	敖东转债	251,341.19	0.00
30	113528	长城转债	247,512.40	0.00
31	113545	金能转债	239,195.40	0.00
32	113024	核建转债	203,915.30	0.00
33	110060	天路转债	200,503.00	0.00
34	110056	亨通转债	186,013.70	0.00
35	110052	贵广转债	177,117.50	0.00
36	123022	长信转债	174,356.80	0.00
37	128064	司尔转债	171,857.40	0.00
38	128075	远东转债	153,556.00	0.00
39	127013	创维转债	136,825.00	0.00
40	113530	大丰转债	119,901.60	0.00
41	123023	迪森转债	114,782.00	0.00
42	128100	搜特转债	69,961.00	0.00
43	127011	中鼎转 2	60,625.00	0.00
44	113030	东风转债	30,878.40	0.00
45	110043	无锡转债	3,380.40	0.00
46	113594	淳中转债	3,360.90	0.00
47	110038	济川转债	1,049.70	0.00
48	113505	杭电转债	1,042.60	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五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	300123	亚光科技	27,029,072.00	0.52	大宗交易购入流通受限
2	000723	美锦能源	20,681,067.24	0.40	非公开发行流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级	持有人	户均持有	持有人结构
-----	-----	------	-------

别	户数 (户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
兴全沪 深 300 指 数 (LOF) A	690,988	2,715.00	386,829,176.40	20.62	1,489,205,972.49	79.38
兴全沪 深 300 指数 C	33,744	1,629.44	487,626.54	0.89	54,496,243.05	99.11
合计	724,732	2,664.46	387,316,802.94	20.06	1,543,702,215.54	79.94

8.2 期末上市基金前十名持有人

兴全沪深 300 指数（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	何三娣	1,002,816.00	2.31
2	浙江德源智能科技股份有限公司	914,447.00	2.11
3	钱春香	809,501.00	1.87
4	高怀之	787,165.00	1.82
5	郭曼	713,950.00	1.65
6	陈周阳	661,000.00	1.52
7	欧阳兰	623,167.00	1.44
8	何雅丽	619,521.00	1.43
9	钟贵洋	581,528.00	1.34
10	李广涛	460,007.00	1.06

注：持有人为 LOF 基金场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	兴全沪深 300 指数（LOF）A	4,078,168.15	0.2174
	兴全沪深 300 指数 C	1,245.57	0.0023
	合计	4,079,413.72	0.2113

注：“占基金总份额比例”对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总数）。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴全沪深 300 指数（LOF）A	0~10
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴全沪深 300 指数（LOF）A	>100
	兴全沪深 300 指数 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴全沪深 300 指数（LOF）A	兴全沪深 300 指数 C
基金合同生效日 （2010 年 11 月 2 日）基金份额总额	2,955,476,122.49	—
本报告期期初基金份额总额	1,992,371,296.24	46,263,655.61
本报告期基金总申购份额	729,774,944.78	65,105,418.59
减：本报告期基金总赎回份额	846,111,092.13	56,385,204.61
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,876,035,148.89	54,983,869.59

注：1、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。

2、自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 类份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）报告期内基金管理人无重大人事变动。

（2）报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	1,087,876,555.40	100.00%	796,583.35	100.00%	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	69,043,234.37	100.00%	9,350,091,000.00	100.00%	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）C 份额暂停接受五十万元以上申购、转换转入申请的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-04
2	关于旗下部分基金投资兄弟科技	证券时报及规定互联网	2021-01-07

	(002562)非公开发行的公告	网站	
3	关于旗下部分基金投资盛洋科技(603703)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-07
4	关于旗下部分基金投资三六零(601360)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-08
5	关于旗下部分基金投资一汽夏利(000927)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-01-09
6	关于旗下部分基金投资美锦能源(000723)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-01
7	关于旗下部分基金投资范围增加存托凭证并修改基金合同和托管协议的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-09
8	关于调整旗下基金在湘财证券费率优惠活动的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-10
9	关于旗下部分基金投资华友钴业(603799)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-20
10	关于旗下部分基金投资四维图新(002405)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-25
11	关于兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）A 份额暂停接受大额申购、转换转入、定期定额投资申请的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-02-26
12	关于旗下部分基金投资双杰电气(300444)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-02
13	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-05
14	关于旗下部分基金投资金证股份(600446)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-31
15	关于旗下部分基金投资美康生物(300439)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-31
16	关于旗下部分基金修改基金合同的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-03-31
17	关于增加阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-01
18	关于旗下部分基金投资银宝山新(002786)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-15
19	增加上海大智慧为旗下部分基金销售机构公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-21
20	关于旗下部分基金投资天坛生物(600161)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-28
21	关于旗下部分基金投资古越龙山(600059)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-04-30
22	关于旗下部分基金投资长电科技(600584)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-06

23	关于旗下部分基金投资惠伦晶体(300460)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-11
24	关于旗下部分基金投资吴通控股(300292)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-05-26
25	关于旗下部分基金投资彩讯股份(300634)非公开发行的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-12
26	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-16
27	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	证券时报及规定互联网网站	2021-06-17
28	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	证券时报及规定互联网网站	2021-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件
- 2、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）基金合同》

- 3、《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日