

兴全可转债混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	44
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全可转债混合型证券投资基金
基金简称	兴全可转债混合
基金主代码	340001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 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	3,330,531,611.57 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴全可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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)
本期已实现收益	159,977,700.90
本期利润	62,348,829.53
加权平均基金份额本期利润	0.0201
本期加权平均净值利润率	1.69%
本期基金份额净值增长率	1.51%
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	417,148,525.91
期末可供分配基金份额利润	0.1252
期末基金资产净值	4,018,879,989.36
期末基金份额净值	1.2067
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	990.44%

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。

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

阶段	份额净值 值增长	份额净值 增长率标	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④
----	-------------	--------------	----------------	------------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	0.32%	0.46%	-0.31%	0.41%	0.63%	0.05%
过去三个月	3.39%	0.48%	4.11%	0.39%	-0.72%	0.09%
过去六个月	1.51%	0.76%	3.36%	0.56%	-1.85%	0.20%
过去一年	18.21%	0.81%	13.12%	0.70%	5.09%	0.11%
过去三年	48.44%	0.73%	38.46%	0.70%	9.98%	0.03%
自基金合同生效起至今	990.44%	0.81%	187.62%	1.10%	802.82%	-0.29%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：选取中证可转换债券指数和沪深 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“中证可转换债券指数”是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。沪深 300 指数代表效果较好。

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：

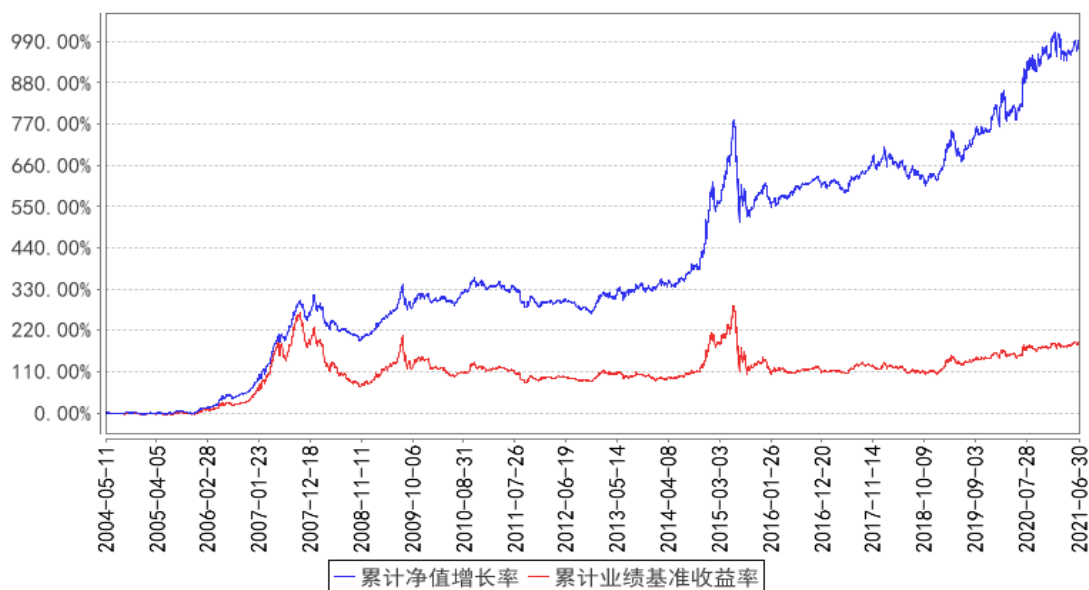
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中证可转换债券指数}_t / \text{中证可转换债券指数}_{t-1} - 1) + 15\% \times (\text{沪深 300 指数}_t / \text{沪深 300 指数}_{t-1} - 1) + 5\% \times (\text{同业存款利率}_t / 360)$$

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

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

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

兴全可转债混合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《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2004 年 5 月 11 日至 2004 年 11 月 10 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。

3.3 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		
虞淼	兴全可转债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基金经理	2019 年 1 月 16 日	-	11 年	硕士，历任兴业证券股份有限公司研究所行业研究员，兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、专户投资部投资经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

是否存在不公平的因素。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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

2021 年上半年国内的信用扩张有所放缓，而经济数据则呈现出一定的韧性。上半年各月 PMI 均在 50 的荣枯线以上，二季度开始略有回落。随着货币政策的正常化，新增社融低于去年同期，上半年累计比去年少增约 3.1 万亿，结构上表外融资远低于去年同期，而新增企业中长期贷款维持双位数增长，显示制造业景气度仍然较高。随着新冠疫苗的普及，部分国家疫情有所改善，但整体感染人数仍持续增加，各国的货币政策仍偏松，在全球流动性宽松的环境下，全球风险资产趋于活跃，部分大宗商品价格也创出新高。

2021 年上半年权益市场延续了分化的格局，波动加大，且行情阶段性趋于极致。上半年上证指数上涨 3.4%，而创业板指上涨 17.2%，创业板第三年跑赢上证指数。板块间分化明显，电气设备、钢铁、化工行业涨幅较大，而家电、非银行金融行业指数下跌。风格的波动比指数显示的更为剧烈，部分板块在春节前持续大涨，却也在二季度遭遇大幅回调。国债利率在货币政策正常化，以及经济动能边际回落的环境下，维持区间震荡，10 年期国债收益率在 3%-3.3% 之间波动，对于工业品价格的抬升相对不敏感。

中证转债指数在 2021 年上半年上涨 4%。1 月份由于流动性边际收紧，转债的整体估值有所收缩。随着后续货币基调维持中性偏松，中小市值个股趋于活跃，转债的估值也稳步抬升，在年中回到了中性偏高的位置。可转债市场在很大程度上仍反映了权益市场的格局和共识，分化明显，债市阶段性走强带动了低价券估值的抬升，而极致的分化格局使得部分高价转债受正股带动，表现持续强势。

基金 2021 年上半年维持了相对较高的股票仓位，可转债持仓以平衡性转债作为主要的配置。在相对极致的分化行情下，对部分表现较好行业转债的整体持仓比例偏低，导致上半年的收益并不突出，而个别转债未在高价区域兑现，也阶段性影响了组合的表现。股票的持仓结构相对均衡，部分持仓个股虽然估值合理甚至偏低，但基本面不同程度地遭遇了一些挑战，使得股价表现持续偏弱。

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 1.2067 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.51%，业绩比较基准收益率为 3.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球疫情的演绎，及其带来的经济复苏的节奏，和货币政策的变化，可能仍将是影响权益市场的重要因素。国内经济复苏趋势阶段性出现波折，货币政策维持中性偏松基调，以应对经济下行的压力。权益在相对低利率环境下的配置价值逐步受到认可，市场持续活跃，同时行业间的估值差异明显，部分资产的估值处于较高水平，可能出现阶段性高波动，行业分化成为常态，对结构性机会的把握，以及结构性风险的认知，可能仍将是一段时期的主基调。

可转债市场的估值处于历史中等偏高的水平。相对偏低的利率水平和相对活跃的权益市场，对于可转债市场有一定支撑。可转债从中期看仍具备一定的配置价值，但相对高估值隐含的对权益和转债资产较高的预期，使得 2021 年下半年获取高收益可能将面临更多的挑战。

本基金将秉承“严控下行风险”的优良传统，灵活配置资产，挑选价值类型的个券，尽量追求“安全的收益”。

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的事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、监察稽核人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定，定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查，确保估值委员会决议的有效执行，负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，本基金托管人在对兴全可转债混合型证券投资基金的托管过程中，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，兴全可转债混合型证券投资基金的管理人——兴证全球基金管理有限公司在兴全可转债混合型证券投资基金的投资运作、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，兴全可转债混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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可转债混合型证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

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	902,259,176.33	483,494,248.63
结算备付金		13,982,912.44	1,590,719.57
存出保证金		230,719.43	381,639.91

交易性金融资产	6.4.7.2	3,106,199,110.83	3,125,502,349.58
其中：股票投资		996,725,324.88	873,581,690.98
基金投资		-	-
债券投资		2,109,473,785.95	2,251,920,658.60
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	600,000,000.00	-
应收证券清算款		-	12,583,263.11
应收利息	6.4.7.5	4,713,713.08	3,854,524.95
应收股利		-	-
应收申购款		2,176,228.77	2,996,525.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,629,561,860.88	3,630,403,271.03
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		-	-
应付证券清算款		595,136,567.01	-
应付赎回款		9,645,739.12	14,066,685.11
应付管理人报酬		4,290,737.47	4,100,395.72
应付托管费		825,141.82	788,537.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	650,998.78	1,024,503.50
应交税费		24,115.39	24,276.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,571.93	209,627.90
负债合计		610,681,871.52	20,214,026.57
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	3,330,531,611.57	3,037,179,298.05
未分配利润	6.4.7.10	688,348,377.79	573,009,946.41
所有者权益合计		4,018,879,989.36	3,610,189,244.46
负债和所有者权益总计		4,629,561,860.88	3,630,403,271.03

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2067 元，基金份额总额 3,330,531,611.57 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		92,728,729.94	156,056,135.80
1. 利息收入		7,104,195.30	10,715,601.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	926,855.19	1,211,325.75
债券利息收入		5,119,093.27	9,504,275.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,058,246.84	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		182,467,874.25	303,220,963.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	80,313,640.70	118,434,581.59
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	95,545,223.13	168,252,764.26
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	6,609,010.42	16,533,617.90
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-97,628,871.37	-160,753,701.45
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	785,531.76	2,873,272.40
减：二、费用		30,379,900.41	39,934,502.29
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,739,096.83	31,156,100.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,565,210.90	5,991,557.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,954,762.65	2,658,814.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		14,091.23	20,859.33
7. 其他费用	6.4.7.20	106,738.80	107,169.70

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		62,348,829.53	116,121,633.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		62,348,829.53	116,121,633.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全可转债混合型证券投资基金

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）	3,037,179,298.05	573,009,946.41	3,610,189,244.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	62,348,829.53	62,348,829.53
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）	293,352,313.52	52,989,601.85	346,341,915.37
其中：1. 基金申购款	991,181,221.67	189,415,852.36	1,180,597,074.03
2. 基金赎回款	-697,828,908.15	-136,426,250.51	-834,255,158.66
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）	3,330,531,611.57	688,348,377.79	4,018,879,989.36
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）	4,140,575,815.63	887,812,218.52	5,028,388,034.15
二、本期经营活	-	116,121,633.51	116,121,633.51

动产生的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-526,233,084.22	-120,108,997.70	-646,342,081.92
其中：1. 基金申购款	1,628,425,794.87	376,906,037.08	2,005,331,831.95
2. 基金赎回款	-2,154,658,879.09	-497,015,034.78	-2,651,673,913.87
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）	3,614,342,731.41	883,824,854.33	4,498,167,585.74

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴全可转债混合型证券投资基金(原名兴业可转债混合型证券投资基金,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”)证监基金字[2004]27号文《关于同意兴业可转债混合型证券投资基金设立的批复》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2004年5月11日正式生效,首次设立募集规模为3,282,404,810.93份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构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。本基金于2011年1月1日起更名为兴全可转债混合型证券投资基金。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、存托凭证、国债,以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。资产配置比例为:可转债30%~95%(其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于50%),股票不高于30%,现金

和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金业绩比较基准为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率”。

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司抵扣代缴个人所得税；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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本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	902,259,176.33
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	902,259,176.33

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	892,440,984.35	996,725,324.88	104,284,340.53
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,020,086,032.19	2,109,473,785.95
	银行间市场	-	-
	合计	2,020,086,032.19	2,109,473,785.95
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,912,527,016.54	3,106,199,110.83	193,672,094.29

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	600,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	600,000,000.00	-

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	50,261.27
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	5,663.07
应收债券利息	4,657,695.23
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	93.51
合计	4,713,713.08

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	650,998.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	650,998.78

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	21,791.48
应付证券出借违约金	-
预提审计费	27,273.08
预提信息披露费	59,507.37
合计	108,571.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,037,179,298.05	3,037,179,298.05
本期申购	991,181,221.67	991,181,221.67
本期赎回（以“-”号填列）	-697,828,908.15	-697,828,908.15
- 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	3,330,531,611.57	3,330,531,611.57

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	220,705,031.42	352,304,914.99	573,009,946.41
本期利润	159,977,700.90	-97,628,871.37	62,348,829.53
本期基金份额交易产生的变动数	36,465,793.59	16,523,808.26	52,989,601.85
其中：基金申购款	109,926,275.87	79,489,576.49	189,415,852.36
基金赎回款	-73,460,482.28	-62,965,768.23	-136,426,250.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	417,148,525.91	271,199,851.88	688,348,377.79

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	850,464.95
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	46,691.19
其他	29,699.05
合计	926,855.19

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	80,313,640.70
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	80,313,640.70

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	667,207,095.59

减：卖出股票成本总额	586,893,454.89
买卖股票差价收入	80,313,640.70

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

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	95,545,223.13
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	95,545,223.13

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	1,042,442,840.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	944,893,669.84
减：应收利息总额	2,003,947.87
买卖债券差价收入	95,545,223.13

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	6,609,010.42
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	6,609,010.42

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	-97,628,871.37

股票投资	-90,145,832.91
债券投资	-7,483,038.46
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	-97,628,871.37

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	742,798.94
基金转换费收入	42,732.82
合计	785,531.76

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	1,954,762.65
银行间市场交易费用	-
合计	1,954,762.65

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
银行手续费	1,358.35
合计	106,738.80

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2021 年 7 月 30 日对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 1.36 元进行分红，实际分配收益为人民币 446,775,391.58 元。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证全球基金管理有限公司（“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（“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（“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	320,853,246.26	27.34	501,720,984.80	32.89

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	310,556,421.89	20.45	832,082,099.77	31.95

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	400,000,000.00	4.30	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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	234,638.95	20.84	200,235.59	30.76
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	366,909.55	24.92	128,816.67	17.24

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	23,739,096.83
其中：支付销售机构的客户维护费	6,526,806.29	5,775,784.19

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30% 的年费率计提。计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.30%/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	4,565,210.90	5,991,557.90

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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：本报告期及上年度可比期间基金管理人均无运用固有资金投资本基金的情况。

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和上年度末均未投资本基金。

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
工商银行	902,259,176.33	850,464.95	418,283,878.77	1,190,267.11

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计算。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于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

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

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
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	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
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	-
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	-
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 1
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	2021	2021	新股	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-

	精密	年 4 月 6 日	年 10 月 15 日	流通 受限						
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	-
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	2021 年 11	新股 流通	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

		17日	月26日	受限						
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	-
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	2021年7月6日	新股流通受限	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
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	-
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	-
600456	宝钛股份	2021年2月25日	2021年8月23日	非公开发行流通受限	42.20	41.19	244,076	10,300,007.20	10,053,490.44	-
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	-
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	-
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	-
688517	金冠电气	2021年6月10日	2021年12月20日	新股流通受限	7.71	11.88	2,892	22,297.32	34,356.96	-
688669	聚石化学	2021年1月15日	2021年7月26日	新股流通受限	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
688687	凯因科技	2021年1月29日	2021年8月9日	新股流通受限	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
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
113050	南银转债	2021年6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	-
127038	国微	2021	2021	新发	100.00	100.00	3,700	370,000.00	370,000.00	-

	转债	年6月 10日	年7月 14日	未上 市						
--	----	------------	------------	---------	--	--	--	--	--	--

注：1、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。

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有流通受限证券。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金于报告期及上年度可比期间均未参与因转融通证券出借业务而出借的证券。

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、风险管理部和合规管理部以及审计部、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	678,840,593.60	796,109,384.27
AAA 以下	1,430,633,192.35	1,406,026,274.33
未评级	-	-
合计	2,109,473,785.95	2,202,135,658.60

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、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	902,259,176.33	-	-	-	-	-	902,259,176.33
结算备付金	13,982,912.44	-	-	-	-	-	13,982,912.44
存出保证金	230,719.43	-	-	-	-	-	230,719.43
交易性金融资产	5,520,593.76	-	-	1,241,943,881.51	862,009,310.68	996,725,324.88	3,106,199,110.83
买入返售金融资产	600,000,000.00	-	-	-	-	-	600,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	4,713,713.08	4,713,713.08
应收申购款	51,079.22	-	-	-	-	2,125,149.55	2,176,228.77
资产总计	1,522,044,481.18	-	-	1,241,943,881.51	862,009,310.68	1,003,564,187.51	4,629,561,860.88
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,645,739.12	9,645,739.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,290,737.47	4,290,737.47
应付托管费	-	-	-	-	-	825,141.82	825,141.82
应付证券清算款	-	-	-	-	-	595,136,567.01	595,136,567.01
应付交易费用	-	-	-	-	-	650,998.78	650,998.78
应交税费	-	-	-	-	-	24,115.39	24,115.39
其他负债	-	-	-	-	-	108,571.93	108,571.93
负债总计	-	-	-	-	-	610,681,871.52	610,681,871.52
利率敏感度缺口	1,522,044,481.18	-	-	1,241,943,881.51	862,009,310.68	392,882,315.99	4,018,879,989.36
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	483,494,248.63	-	-	-	-	-	483,494,248.63
结算备付金	1,590,719.57	-	-	-	-	-	1,590,719.57

存出保证金	381,639.91	-	-	-	-	-	381,639.91
交易性金融资产	5,653,125.40	-	49,785,000.00	1,138,880,010.19	1,057,602,523.01	873,581,690.98	3,125,502,349.58
应收利息	-	-	-	-	-	3,854,524.95	3,854,524.95
应收申购款	57,723.85	-	-	-	-	2,938,801.43	2,996,525.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	12,583,263.11	12,583,263.11
资产总计	491,177,457.36	-	49,785,000.00	1,138,880,010.19	1,057,602,523.01	892,958,280.47	3,630,403,271.03
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,066,685.11	14,066,685.11
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,100,395.72	4,100,395.72
应付托管费	-	-	-	-	-	788,537.64	788,537.64
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,024,503.50	1,024,503.50
应交税费	-	-	-	-	-	24,276.70	24,276.70
其他负债	-	-	-	-	-	209,627.90	209,627.90
负债总计	-	-	-	-	-	20,214,026.57	20,214,026.57
利率敏感度缺口	491,177,457.36	-	49,785,000.00	1,138,880,010.19	1,057,602,523.01	872,744,253.90	3,610,189,244.46

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。

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)		上年度末(2020年12月31日)
	本期末(2021年6月30日)		
分析	利率 +1%	-	-147,125.38

	利率 -1%	-	148,000.10
--	--------	---	------------

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，为交易而持有的债券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不超过基金资产净值的 30%；可转债为 30%-95%；现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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	996,725,324.88	24.80	873,581,690.98	24.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,109,473,785.95	52.49	2,251,920,658.60	62.38
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	3,106,199,110.83	77.29	3,125,502,349.58	86.57

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%	373, 102, 772. 90	310, 439, 882. 98
	业绩比较基准-10%	-373, 102, 772. 90	-310, 439, 882. 98

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	996, 725, 324. 88	21. 53
	其中: 股票	996, 725, 324. 88	21. 53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2, 109, 473, 785. 95	45. 57
	其中: 债券	2, 109, 473, 785. 95	45. 57
	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	600, 000, 000. 00	12. 96
	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	916, 242, 088. 77	19. 79
8	其他各项资产	7, 120, 661. 28	0. 15
9	合计	4, 629, 561, 860. 88	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	92,785,897.32	2.31
C	制造业	588,368,971.95	14.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,054,401.00	0.55
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	8,666,425.17	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	5,895,832.80	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,716,899.23	0.96
J	金融业	119,811,824.74	2.98
K	房地产业	107,393,345.14	2.67
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	676,801.45	0.02
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	12,293,590.68	0.31
	合计	996,725,324.88	24.80

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	9,575,428	92,785,897.32	2.31
2	002025	航天电器	1,739,094	87,250,345.98	2.17
3	600048	保利地产	6,837,489	82,323,367.56	2.05
4	002415	海康威视	1,009,459	65,110,105.50	1.62
5	601166	兴业银行	2,601,900	53,469,045.00	1.33
6	600690	海尔智家	1,942,810	50,338,207.10	1.25
7	000001	平安银行	1,795,300	40,609,686.00	1.01

8	600426	华鲁恒升	1,289,005	39,894,704.75	0.99
9	002876	三利谱	492,660	31,875,102.00	0.79
10	002138	顺络电子	776,420	30,101,803.40	0.75
11	000738	航发控制	1,442,124	30,039,442.92	0.75
12	603218	日月股份	1,045,615	28,315,254.20	0.70
13	601318	中国平安	399,788	25,698,372.64	0.64
14	000002	万科A	1,052,918	25,069,977.58	0.62
15	300207	欣旺达	745,063	24,259,251.28	0.60
16	688099	晶晨股份	214,727	24,092,369.40	0.60
17	600741	华域汽车	909,250	23,885,997.50	0.59
18	600031	三一重工	804,082	23,374,663.74	0.58
19	002049	紫光国微	149,681	23,079,313.39	0.57
20	600674	川投能源	1,788,300	22,049,739.00	0.55
21	002508	老板电器	466,600	21,696,900.00	0.54
22	002938	鹏鼎控股	556,700	19,974,396.00	0.50
23	300791	仙乐健康	302,550	16,761,270.00	0.42
24	002212	天融信	738,600	14,602,122.00	0.36
25	002050	三花智控	608,925	14,602,021.50	0.36
26	603707	健友股份	348,530	14,551,127.50	0.36
27	601012	隆基股份	144,095	12,801,399.80	0.32
28	000009	中国宝安	672,884	12,293,590.68	0.31
29	688005	容百科技	87,983	10,663,539.60	0.27
30	600456	宝钛股份	244,076	10,053,490.44	0.25
31	000785	居然之家	1,416,431	8,597,736.17	0.21
32	002120	韵达股份	435,760	5,895,832.80	0.15
33	002332	仙琚制药	439,338	5,509,298.52	0.14
34	002851	麦格米特	76,438	2,387,158.74	0.06
35	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.02
36	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
37	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
38	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
39	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.00
40	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
41	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.00
42	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
43	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
44	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
45	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
46	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
47	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
48	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
49	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00

50	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
51	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
52	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
53	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
54	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
55	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
56	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
57	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
58	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
59	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
60	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
61	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
62	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
63	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
64	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
65	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
66	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
67	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
68	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
69	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
70	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
71	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
72	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
73	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
74	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
75	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
76	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
77	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
78	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
79	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
80	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
81	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
82	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
83	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
84	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
85	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
86	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
87	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
88	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
89	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
90	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
91	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00

92	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
93	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
94	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	601899	紫金矿业	113,253,608.28	3.14
2	002444	巨星科技	75,174,979.20	2.08
3	002460	赣锋锂业	41,933,807.10	1.16
4	002025	航天电器	33,294,251.73	0.92
5	601012	隆基股份	29,794,603.50	0.83
6	603218	日月股份	27,883,794.84	0.77
7	300059	东方财富	27,875,948.72	0.77
8	000738	航发控制	27,508,205.33	0.76
9	002876	三利谱	26,184,467.70	0.73
10	002138	顺络电子	22,127,829.34	0.61
11	002508	老板电器	21,136,957.00	0.59
12	600674	川投能源	20,867,559.00	0.58
13	002049	紫光国微	19,851,994.57	0.55
14	300316	晶盛机电	18,552,614.12	0.51
15	603501	韦尔股份	18,520,236.00	0.51
16	002001	新和成	18,273,579.00	0.51
17	002938	鹏鼎控股	18,160,254.00	0.50
18	601166	兴业银行	17,607,271.66	0.49
19	600919	江苏银行	17,141,471.60	0.47
20	601009	南京银行	15,772,118.00	0.44

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	002444	巨星科技	64,412,076.24	1.78
2	601899	紫金矿业	58,789,357.35	1.63
3	601012	隆基股份	57,212,231.26	1.58
4	002460	赣锋锂业	46,350,735.90	1.28
5	002064	华峰化学	34,722,746.09	0.96
6	300059	东方财富	29,809,039.04	0.83
7	600031	三一重工	27,363,343.00	0.76
8	601318	中国平安	26,798,095.60	0.74
9	300316	晶盛机电	23,143,727.87	0.64

10	000910	大亚圣象	20,105,372.49	0.56
11	300207	欣旺达	19,758,498.32	0.55
12	002001	新和成	18,316,423.44	0.51
13	002851	麦格米特	17,451,567.05	0.48
14	600919	江苏银行	17,170,887.60	0.48
15	002044	美年健康	16,747,849.00	0.46
16	603501	韦尔股份	16,229,362.00	0.45
17	601009	南京银行	15,079,437.50	0.42
18	002773	康弘药业	13,748,335.15	0.38
19	002600	领益智造	13,664,752.78	0.38
20	002025	航天电器	11,932,877.00	0.33

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	800,182,921.70
卖出股票收入（成交）总额	667,207,095.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	2,109,473,785.95	52.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,109,473,785.95	52.49

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	110045	海澜转债	1,148,600	128,218,218.00	3.19
2	110075	南航转债	1,013,740	124,578,508.60	3.10
3	123111	东财转3	838,044	122,656,119.84	3.05
4	110053	苏银转债	846,640	102,748,230.40	2.56

5	113014	林洋转债	908,490	98,480,316.00	2.45
---	--------	------	---------	---------------	------

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，海澜之家集团股份有限公司、中国南方航空股份有限公司、江苏银行股份有限公司、兴业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	230,719.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,713,713.08
5	应收申购款	2,176,228.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,120,661.28

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	110045	海澜转债	128,218,218.00	3.19
2	110075	南航转债	124,578,508.60	3.10
3	110053	苏银转债	102,748,230.40	2.56
4	113014	林洋转债	98,480,316.00	2.45
5	132018	G 三峡 EB1	96,145,249.20	2.39
6	110059	浦发转债	95,362,330.00	2.37
7	128109	楚江转债	92,903,571.18	2.31
8	110051	中天转债	80,468,270.80	2.00
9	110072	广汇转债	76,388,157.50	1.90
10	128129	青农转债	56,445,482.34	1.40
11	128097	奥佳转债	50,649,517.62	1.26
12	113043	财通转债	45,363,521.10	1.13
13	127005	长证转债	40,426,068.26	1.01
14	113588	润达转债	40,040,391.00	1.00
15	113615	金诚转债	39,452,627.20	0.98
16	113508	新风转债	38,399,096.10	0.96
17	123092	天壕转债	38,296,838.16	0.95
18	110047	山鹰转债	34,671,990.60	0.86
19	128018	时达转债	34,625,215.92	0.86
20	110073	国投转债	33,558,127.60	0.84
21	128105	长集转债	32,796,684.80	0.82
22	127018	本钢转债	30,772,398.24	0.77
23	123035	利德转债	30,621,933.30	0.76
24	132020	19 蓝星 EB	30,511,756.80	0.76
25	113534	鼎胜转债	29,763,627.20	0.74
26	123050	聚飞转债	29,062,795.74	0.72

27	113543	欧派转债	26,302,350.50	0.65
28	128130	景兴转债	22,650,569.92	0.56
29	127022	恒逸转债	19,630,562.40	0.49
30	113611	福 20 转债	19,301,614.40	0.48
31	113542	好客转债	19,160,840.00	0.48
32	113606	荣泰转债	18,057,596.00	0.45
33	128135	洽洽转债	17,746,337.40	0.44
34	110076	华海转债	16,805,224.80	0.42
35	123081	精研转债	16,080,292.20	0.40
36	110063	鹰 19 转债	15,717,447.90	0.39
37	128075	远东转债	15,604,242.60	0.39
38	128137	洁美转债	15,219,533.42	0.38
39	128022	众信转债	14,747,950.50	0.37
40	128032	双环转债	14,283,588.55	0.36
41	110067	华安转债	11,556,243.60	0.29
42	128121	宏川转债	10,444,382.34	0.26
43	113504	艾华转债	7,903,556.70	0.20
44	123090	三诺转债	7,158,476.50	0.18
45	127023	华菱转 2	5,520,593.76	0.14
46	123076	强力转债	2,998,663.36	0.07

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

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 (%)
171,728	19,394.23	689,016,657.29	20.69	2,641,514,954.28	79.31

8.2 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	3,407,536.63	0.1023

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和研部	0~10

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 5 月 11 日） 基金份额总额	3,282,404,810.93
本报告期期初基金份额总额	3,037,179,298.05
本报告期基金总申购份额	991,181,221.67
减：本报告期基金总赎回份额	697,828,908.15
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	3,330,531,611.57

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。

§ 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，基金托管人中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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	
光大证券	1	388,029,646.97	33.06%	392,985.49	34.90%	-
兴业证券	2	320,853,246.26	27.34%	234,638.95	20.84%	-
申万宏源证券	1	275,863,574.05	23.51%	292,122.83	25.95%	-
国泰君安	2	111,831,796.24	9.53%	115,983.82	10.30%	-
中信建投证券	1	77,031,185.94	6.56%	78,868.71	7.00%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	11,325.60	1.01%	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

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
光大证券	526,924,290.33	34.69%	-	-	-	-
兴业证券	310,556,421.89	20.45%	400,000,000.00	4.30%	-	-
申万宏源证券	374,064,156.77	24.63%	5,800,000,000.00	62.37%	-	-
国泰君安	120,928,902.43	7.96%	1,600,000,000.00	17.20%	-	-
中信建投	72,003,813.20	4.74%	1,500,000,000.00	16.13%	-	-

证券						
国盛证券		-	-	-	-	-
国元证券		-	-	-	-	-
中金公司	114,400,000.00	7.53%		-	-	-
中银国际 证券		-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	上海证券报、规定互联网网站	2021-02-09
2	关于调整旗下基金在湘财证券费率优惠活动的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-02-10
3	关于旗下部分基金投资宝钛股份(600456)非公开发行股票的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-02-27
4	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-03-05
5	关于增加阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-04-01
6	关于兴全可转债混合型证券投资基金暂停接受一百万元以上申购、转换转入、定期定额投资申请的公告	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-15
7	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	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-16
8	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	上海证券报、规定互联网网站	2021-06-17
9	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	上海证券报、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、中国证监会批准本基金设立的文件
- 2、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《兴全可转债混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

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