

兴全绿色投资混合型证券投资基金 (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	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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 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	39
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	42
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	44

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	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末上市基金前十名持有人	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
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	48
10.8 其他重大事件	49
§ 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	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
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	兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	兴全绿色投资混合（LOF）
场内简称	兴全绿色
基金主代码	163409
前端交易代码	163409
后端交易代码	163410
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2011 年 5 月 6 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,562,995,186.69 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 7 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，力争实现当期投资收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在大类资产配置上，采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。在运用“绿色投资筛选策略”的基础上，采用环境因子与公司财务等基本因子相结合，进行综合评估筛选，对那些表现相对突出的公司予以优先考虑。
业绩比较基准	80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。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。

注：本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数，修改后的业绩比较基准为：80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

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	中国证券报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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	397,478,463.63
本期利润	657,035,083.16
加权平均基金份额本期利润	0.3856
本期加权平均净值利润率	18.32%
本期基金份额净值增长率	18.42%
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	2,957,432,873.56
期末可供分配基金份额利润	1.1539
期末基金资产净值	5,814,977,364.84
期末基金份额净值	2.269
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	413.31%

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息

披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.94%	0.91%	-2.69%	0.66%	6.63%	0.25%
过去三个月	11.06%	0.93%	0.86%	0.86%	10.20%	0.07%
过去六个月	18.42%	1.31%	-1.20%	1.15%	19.62%	0.16%
过去一年	52.85%	1.28%	21.23%	1.10%	31.62%	0.18%
过去三年	155.77%	1.35%	43.07%	1.10%	112.70%	0.25%
自基金合同生效起至今	413.31%	1.47%	71.21%	1.15%	342.10%	0.32%

注：本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数，修改后的业绩比较基准为：80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数由中证指数有限公司发布，它从沪深 300 指数成分股中选取了在环境（E）、社会责任（S）和公司治理水平（G）方面处于行业前列，且盈利能力突出的 100 只上市公司股票。该指数成分股均为有代表性的绿色企业，能够反映国内绿色产业发展趋势，也与本基金的绿色投资方向高度契合，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中证国债指数由中

证指数有限公司发布，该指数样本券由剩余年限 1 年及以上且在沪深交易所或银行间市场上市的国债构成，能够反映全市场相应期限国债的表现，是具有代表性的债券市场指数，适合作为本基金债券投资业绩比较基准。

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：

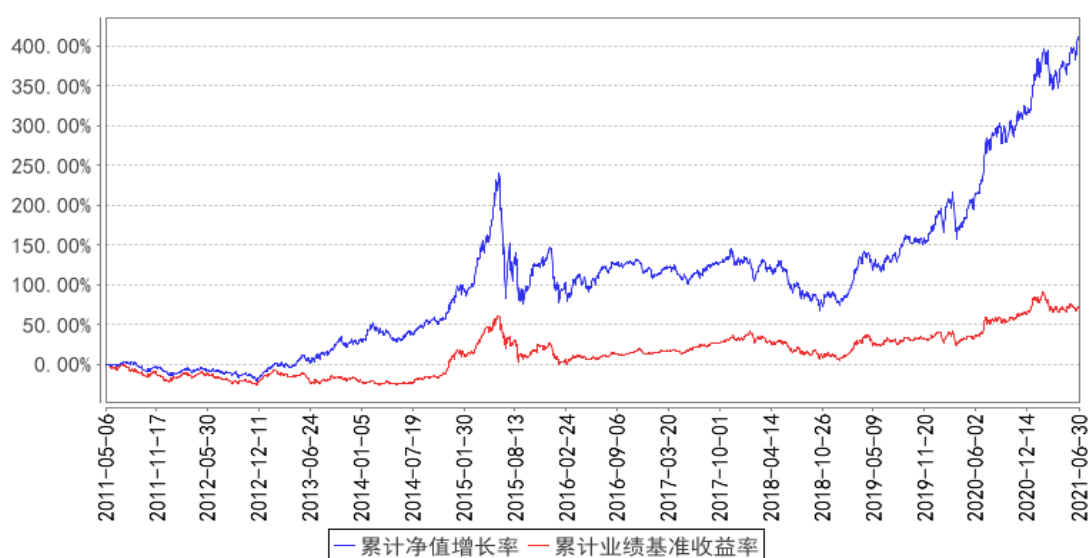
$$\text{Return}_t = 80\% \times (\text{中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率}_t / \text{中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中证国债指数收益率}_t / \text{中证国债指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

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

兴全绿色投资混合（LOF）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《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定，本基金建仓期为 2011 年 5 月 6 日至 2011 年 8 月 5 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3、本基金原业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数，修改后的业绩比较基准为：80%×中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率+20%×中证国债指数收益率，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

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		
邹欣	本基金基金经理	2017 年 6 月 29 日	—	12 年	硕士，历任富国基金管理有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，兴全基金管理有限公司研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、研究部总监助理。

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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（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

21 年上半年，本基金在基本没有电动车和半导体持仓的情况下业绩差强人意，在期末由于整个市场的累积涨幅下大多数股票的风险收益比降低，持仓也比较分散。但最大的变化是管理规模的大幅提高，基金经理在感谢持有人的信任之余，更多的是感受到了沉甸甸的责任，压力来自于两方面，显性的是管理难度的增加，但隐性的或者更加重要的是担心新进的持有人对本基金了解不够充分，对管理风格和短期业绩的预期有所偏差。

持有时间不长、总是追着买入前期表现较好的产品而产品收益不稳定、赚了指数不赚钱等一直是基金投资的主要问题，我们理解关键原因还是在于持有人看不到工厂，“认知”这座工厂在基金经理的大脑中，看不见摸不着的持有人作为客户便只能以短期结果考核，所以基金经理其实有责任至少告诉持有人我们的工厂是如何设计的，因为持有人的职业大多属于非金融行业，所以我们也尽量采用和实业相近的语言来进行表达。

首先有两个类似数学公理的假设：

1. 自下而上先研究实体经济的产业规律比先研究股市的规律更容易。
2. 关乎产业和企业未来成长的投资对我们而言有更多的研究空间，在成熟行业建立超越前人的深度认知难度更大一些。

基于上述公理，本基金经理选择了以探寻产业规律为本的成长投资方法，去标签的真成长是

我们希冀的主要收益来源。

20 年年报中我们阐述过对自身岗位的认识就像生产线上的操作工，职责是加工研究员传递来的信息，信息是生产过程的原材料，产品是基金的股票组合，而加工工具就是基金经理的认知能力。

基于实业共通的认识，短期看产品质量的主要影响因素是原材料的好坏，而长期来看最重要的影响因素是加工工具的先进性，所以我们一直把重心放在如何提高认知能力的问题上，对于原材料的好坏或者短期市场上怎样的产品好卖或者原材料有没有囤积居奇的机会并不怎么关心。

模型和软件是思维框架的具象，而芯片则是软件思想的固化，本质上是共通的。所以我们采用类似 INTEL 著名的 Tick-Tock 模式来汇报上半年的工作：

1. 在产业深度认知层面，我们在学习半导体工艺和器件，这项工作会将持续 3 年的时间。
2. 在上市公司业务层面，上半年我们阅读了两百多家新股的招股书，搞清楚他们在各自产业链上的位置、盈利模式和商业模式、竞争壁垒，并引发我们重新认识了一些已上市公司。这会是一项长期坚持的工作，每个季度的工作量都基本相当。
3. 在刻画核心矛盾的选股策略层面，我们修正了一些具体的刻画方法，能够观察企业和市场一些更加精细的变化。
4. 在中观行业层面，我们延续了 20Q3 以来的聚类方法，能够自下而上的刻画不同行业战线的重要性，但是对于行业间是等权的。这个方法改善了我们在结构性行情下的表现，但是仍然有改进的空间，在接下来的半年到一年的时间里，我们可能会将新的行业配置思想应用进实践中，模型改造已经完成。
5. 在定价层面，局限于基金经理的视野这部分一直是我们的弱项，但是在我们的认知里，没有扎实基础的类比和讲童话故事差不多，所以改善的工作一直排序靠后。所幸接下来的一年中，我们将着手改善这一问题，前期的准备工作已经展开。

说到这里，大家也许能够更加理解一些收益率波动的原因，金融行业的术语叫做股票定价的艺术成分偏多，科学一些的表述其实就是股价和基本面呈正相关性关系，所以短期涨跌其实是非常不稳定的结果。半导体行业的小伙伴可能一看就懂，这不就是做模拟芯片的意思么，但是为了设计出一枚先进的芯片需要正确的设计和工艺，但是其中可能会有很长时间的 debug 的时间让我们无法接近短期的目标，而采用反向工程的方法短期迎合了客户需求却为长期埋下了诸多隐患，所以我们能做的就是坚持正向工程，用尽量科学和可复制的方法为持有人获取收益。

最后披露一下我们的方法的缺点和不足：

1. 我们希望给持有人提供的是长期具有 alpha 的产品，不是为了配置的工具型产品，所以

我们很难做到保持稳定的 beta。

2. 我们对宏观仍然非常不擅长，在中观行业层面的观察方法稳固之前，对宏观的研究会持续滞后。

3. 由于我们采用了上述类 IDM 的模式，类似虽然三星知道台积电为英伟达的 GPU 开发了某些特殊工艺也很难迅速应用到自家的产品上，我们的调整也会比较慢，任何针对短期市场情况的反思调整都可能引发在模型工艺甚至架构上的改进，不太有能力进行板块配置上的大开大合调整。

4. 我们寻求对产业规律的深度认知，但是受限于基金经理的认知能力，在很多行业或者领域尚无这样的深度，也就不会在这些行业做非常重的配置，更不会因为别人超配什么行业而超配以追逐热点。

我不知道这篇中报会被哪些持有人读到，也不知道读者会是怎样的背景和理解方式，但就像我们前述所说，希望持有人慎重考虑我们的投资方法和可能的结果是否匹配您的投资目标和风险承受能力，此外在我们的方法中最最欠缺的就是对产业的洞见，如果持有人认可我们的方法，也非常欢迎大家通过各种平台或者渠道给予我们帮助和指导，这样为普通老百姓服务的公募基金投资生态闭环才能够实现。

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 2.269 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.42%，业绩比较基准收益率为-1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们粗浅的认为宏观经济的增速可能处在逐渐放缓的过程，但是还看不到较快失速的风险，针对经济结构调整的政策仍然是有余地的，但是要预防某些局部过热行业的调整，以免本就不多的社会资源被大量浪费出现一地鸡毛的情况。此外，我们在关注疫情对全球经济的影响，这个问题可能会影响我们对短期行业配置的比重。

在近三年的上涨后，我们对证券市场逐渐谨慎，可能经验更加丰富的管理人会更适合投资人。

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》、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（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

本报告期内，本基金托管人在对兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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，兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）的管理人——兴证全球基金管理有限公司在兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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。本报告期内兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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：兴全绿色投资混合型证券投资基金（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	521,203,837.78	50,673,600.35
结算备付金		14,564,938.30	5,769,445.35
存出保证金		1,195,745.13	1,047,295.80
交易性金融资产	6.4.7.2	5,338,482,308.80	3,015,922,959.02
其中：股票投资		5,044,931,078.10	2,836,665,070.92
基金投资		-	-
债券投资		293,551,230.70	179,257,888.10
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	-	-
应收证券清算款		15,346,330.51	4,241,620.45
应收利息	6.4.7.5	1,121,163.66	2,583,451.72
应收股利		-	-
应收申购款		101,591,080.88	4,520,906.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,993,505,405.06	3,084,759,278.85
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		116,927,937.62	12,575,007.87
应付赎回款		49,143,416.21	46,458,825.06
应付管理人报酬		6,390,541.11	3,829,097.22
应付托管费		1,065,090.21	638,182.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,727,109.77	3,727,316.05
应交税费		228.36	148.38
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	273,716.94	344,070.89
负债合计		178,528,040.22	67,572,648.34
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,562,995,186.69	1,574,392,165.95
未分配利润	6.4.7.10	3,251,982,178.15	1,442,794,464.56
所有者权益合计		5,814,977,364.84	3,017,186,630.51
负债和所有者权益总计		5,993,505,405.06	3,084,759,278.85

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.269 元，基金份额总额 2,562,995,186.69 份。

6.2 利润表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（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		704,331,511.25	115,826,523.70
1. 利息收入		2,938,076.13	520,398.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	441,748.82	71,313.90
债券利息收入		2,496,327.31	449,084.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		439,846,456.93	89,196,939.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	403,176,906.49	84,708,087.44
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,698,465.45	-269,043.68
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	30,971,084.99	4,757,895.95
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	259,556,619.53	25,981,108.84

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	1, 990, 358. 66	128, 076. 53
减：二、费用		47, 296, 428. 09	8, 341, 556. 32
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	26, 520, 812. 62	4, 223, 442. 71
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	4, 420, 135. 46	703, 907. 07
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	16, 243, 252. 18	3, 307, 784. 19
5. 利息支出		525. 97	-
其中：卖出回购金融资产支出		525. 97	-
6. 税金及附加		81. 44	28. 16
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	111, 620. 42	106, 394. 19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		657, 035, 083. 16	107, 484, 967. 38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		657, 035, 083. 16	107, 484, 967. 38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全绿色投资混合型证券投资基金（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）	1, 574, 392, 165. 95	1, 442, 794, 464. 56	3, 017, 186, 630. 51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	657, 035, 083. 16	657, 035, 083. 16
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）	988, 603, 020. 74	1, 152, 152, 630. 43	2, 140, 755, 651. 17
其中：1. 基金申购款	1, 695, 549, 454. 70	1, 924, 528, 296. 48	3, 620, 077, 751. 18
2. 基金	-706, 946, 433. 96	-772, 375, 666. 05	-1, 479, 322, 100. 01

赎回款			
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）	2,562,995,186.69	3,251,982,178.15	5,814,977,364.84
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）	268,259,864.22	253,154,238.10	521,414,102.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	107,484,967.38	107,484,967.38
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）	-3,307,574.08	-4,057,263.59	-7,364,837.67
其中：1. 基金申购款	84,118,982.79	88,096,337.55	172,215,320.34
2. 基金赎回款	-87,426,556.87	-92,153,601.14	-179,580,158.01
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）	264,952,290.14	356,581,941.89	621,534,232.03

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

兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)（原名兴全绿色投资股票型证券投资基金(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[2011]241号《关于核准兴全绿色投资股票型证券投资基金(LOF)募集的批复》的核准，由兴证全球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 2011 年 5 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 2,022,398,091.00 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证全球基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金于 2015 年 8 月 7 日起更名为兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)。

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

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合绿色投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金原业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证国债指数}$ ，修改后的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证兴业证券 ESG 盈利 100 指数收益率} + 20\% \times \text{中证国债指数收益率}$ ，修改后的业绩比较基准生效日为 2020 年 9 月 10 日。

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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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的有关规定的要求，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

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	521,203,837.78
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	521,203,837.78

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	4,658,888,694.20	5,044,931,078.10	386,042,383.90
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	89,974,083.02	102,031,230.70
	银行间市场	191,600,070.00	191,520,000.00
	合计	281,574,153.02	293,551,230.70
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	4,940,462,847.22	5,338,482,308.80	398,019,461.58

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：本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

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	40,199.49
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	5,898.78
应收债券利息	1,074,581.19
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	484.20
合计	1,121,163.66

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	4,724,934.77
银行间市场应付交易费用	2,175.00
合计	4,727,109.77

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	189,414.38
应付证券出借违约金	—

预提审计费用	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	273,716.94

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	1,574,392,165.95	1,574,392,165.95
本期申购	1,695,549,454.70	1,695,549,454.70
本期赎回（以“-”号填列）	-706,946,433.96	-706,946,433.96
- 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	2,562,995,186.69	2,562,995,186.69

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	1,457,123,880.35	-14,329,415.79	1,442,794,464.56
本期利润	397,478,463.63	259,556,619.53	657,035,083.16
本期基金份额交易产生的变动数	1,102,830,529.58	49,322,100.85	1,152,152,630.43
其中：基金申购款	1,840,919,068.24	83,609,228.24	1,924,528,296.48
基金赎回款	-738,088,538.66	-34,287,127.39	-772,375,666.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,957,432,873.56	294,549,304.59	3,251,982,178.15

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	327,486.29
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	79,064.48
其他	35,198.05
合计	441,748.82

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	403,176,906.49
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	403,176,906.49

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	5,957,434,894.49
减：卖出股票成本总额	5,554,257,988.00
买卖股票差价收入	403,176,906.49

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	5,698,465.45
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	5,698,465.45

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	186,544,109.48
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	176,592,754.09
减：应收利息总额	4,252,889.94
买卖债券差价收入	5,698,465.45

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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

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	30,971,084.99
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	30,971,084.99

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	259,556,619.53
股票投资	250,700,675.86
债券投资	8,855,943.67
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	259,556,619.53

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	1,969,072.64
基金转换费收入	21,286.02
合计	1,990,358.66

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	16,241,077.18
银行间市场交易费用	2,175.00
合计	16,243,252.18

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费用	18,600.00
银行费用	8,717.86
合计	111,620.42

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

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要说明的资产负债表日后事项。

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、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	1,466,892,628.99	10.90	1,062,504,256.58	43.03

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	25,483,894.54	24.13	3,146,529.00	20.14

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

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	1,072,742.06	11.83	754,623.06	15.97
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	777,240.05	43.03	236,225.61	32.84

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

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	26,520,812.62	4,223,442.71
其中：支付销售机构的客户维护费	8,009,021.25	1,340,739.73

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 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×1.5%/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	4,420,135.46	703,907.07

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

份额单位：份

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
基金合同生效日（2011 年 5 月 6 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	7,522,455.50	4,765,967.59
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	7,522,455.50	4,765,967.59
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2935%	1.7988%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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
工商银行	521,203,837.78	327,486.29	10,885,450.30	54,918.98

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

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

无。

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
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	750,000	9,367,500.00	6,712,500.00	-
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	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
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	-
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	-
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	-

			日							
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	新股流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688161	威高骨科	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	36.22	82.27	3,069	111,159.18	252,486.63	-

			日							
688533	上声电子	2021 年 4 月 9 日	2021 年 10 月 19 日	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	74.46	373.24	1,673	124,571.58	624,430.52	-
688665	四方光电	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
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	新债未上市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-
127038	国微转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	7,366	736,600.00	736,600.00	-

注：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

注：本基金本期末未持有临时停牌等流通受限股票。

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

注：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

本基金本报告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：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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除国债、央行票据、政策性金融债以外的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	5,303,820.40	15,700,786.60

AAA 以下	92,911,741.20	17,243,701.50
未评级	—	—
合计	98,215,561.60	32,944,488.10

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 2021 年 6 月 30 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	521,203,837.78	-	-	-	-	-	521,203,837.78
结算备付金	14,564,938.30	-	-	-	-	-	14,564,938.30
存出保证金	1,195,745.13	-	-	-	-	-	1,195,745.13
交易性金融资产	-	-	195,335,669.10	-	98,215,561.60	5,044,931.078.10	5,338,482,308.80
应收利息	-	-	-	-	-	1,121,163.66	1,121,163.66
应收申购款	5,347,529.56	-	-	-	-	96,243,551.32	101,591,080.88
应收证券清算款	-	-	-	-	-	15,346,330.51	15,346,330.51
资产总计	542,312,050.77	-	195,335,669.10	-	98,215,561.60	5,157,642,123.59	5,993,505,405.06
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	49,143,416.21	49,143,416.21
应付管理人	-	-	-	-	-	6,390,541.	6,390,541.

报酬						. 11	11
应付托管费	-	-	-	-	-	1, 065, 090 . 21	1, 065, 090. 21
应付证券清算款	-	-	-	-	-	116, 927, 9 37. 62	116, 927, 93 7. 62
应付交易费用	-	-	-	-	-	4, 727, 109 . 77	4, 727, 109. 77
应交税费	-	-	-	-	-	228. 36	228. 36
其他负债	-	-	-	-	-	273, 716. 9 4	273, 716. 94
负债总计	-	-	-	-	-	178, 528, 0 40. 22	178, 528, 04 0. 22
利率敏感度缺口	542, 312, 050 . 77	-	195, 335, 669 . 10	-	98, 215, 56 1. 60	4, 979, 114 , 083. 37	5, 814, 977, 364. 84
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	50, 673, 600. 35	-	-	-	-	-	50, 673, 600 . 35
结算备付金	5, 769, 445. 3 5	-	-	-	-	-	5, 769, 445. 35
存出保证金	1, 047, 295. 8 0	-	-	-	-	-	1, 047, 295. 80
交易性金融资产	5, 999, 400. 0 0	-	140, 314, 000 . 00	14, 078, 7 86. 60	18, 865, 70 1. 50	2, 836, 665 , 070. 92	3, 015, 922, 959. 02
应收利息	-	-	-	-	-	2, 583, 451 . 72	2, 583, 451. 72
应收申购款	16, 641. 76	-	-	-	-	4, 504, 264 . 40	4, 520, 906. 16
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4, 241, 620 . 45	4, 241, 620. 45
资产总计	63, 506, 383. 26	-	140, 314, 000 . 00	14, 078, 7 86. 60	18, 865, 70 1. 50	2, 847, 994 , 407. 49	3, 084, 759, 278. 85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	46, 458, 82 5. 06	46, 458, 825 . 06
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3, 829, 097 . 22	3, 829, 097. 22
应付托管费	-	-	-	-	-	638, 182. 8 7	638, 182. 87
应付证券清算款	-	-	-	-	-	12, 575, 00 7. 87	12, 575, 007 . 87
应付交易费	-	-	-	-	-	3, 727, 316	3, 727, 316.

用						.05	05
应交税费	-	-	-	-	-	148.38	148.38
其他负债	-	-	-	-	-	344,070.89	344,070.89
负债总计	-	-	-	-	-	67,572,648.34	67,572,648.34
利率敏感度 缺口	63,506,383.26	-	140,314,000.00	14,078,786.60	18,865,701.50	2,780,421,759.15	3,017,186,630.51

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）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	利率 +1%	-1,610,699.73	-633,248.19
	利率 -1%	1,637,833.11	639,068.02

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

基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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	5,044,931,078.10	86.76	2,836,665,070.92	94.02
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	293,551,230.70	5.05	179,257,888.10	5.94
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	5,338,482,308.80	91.81	3,015,922,959.02	99.96

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准+10%	508,033,263.00	346,845,874.49
	业绩比较基准-10%	-508,033,263.00	-346,845,874.49

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	5,044,931,078.10	84.17
	其中：股票	5,044,931,078.10	84.17
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	293,551,230.70	4.90
	其中：债券	293,551,230.70	4.90
	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	535,768,776.08	8.94
8	其他各项资产	119,254,320.18	1.99
9	合计	5,993,505,405.06	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	—	—
B	采矿业	468,966,875.21	8.06
C	制造业	3,508,633,621.98	60.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	2,136,348.68	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	56,359,215.00	0.97
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	174,010,759.75	2.99
J	金融业	412,673,655.50	7.10
K	房地产业	93,330,275.36	1.60
L	租赁和商务服务业	83,872,091.24	1.44

M	科学研究和技术服务业	483,080.50	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	14,103.23	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	93,034,405.21	1.60
R	文化、体育和娱乐业	94,110,912.00	1.62
S	综合	57,294,720.00	0.99
	合计	5,044,931,078.10	86.76

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	002415	海康威视	5,211,596	336,147,942.00	5.78
2	000651	格力电器	5,798,351	302,094,087.10	5.20
3	601636	旗滨集团	15,029,877	278,954,517.12	4.80
4	300059	东方财富	7,346,680	240,897,637.20	4.14
5	601857	中国石油	41,436,929	219,201,354.41	3.77
6	002938	鹏鼎控股	4,649,739	166,832,635.32	2.87
7	601899	紫金矿业	15,643,270	151,583,286.30	2.61
8	300115	长盈精密	7,336,652	151,135,031.20	2.60
9	601012	隆基股份	1,400,000	124,376,000.00	2.14
10	000921	海信家电	7,819,468	112,365,755.16	1.93
11	300114	中航电测	7,234,455	109,963,716.00	1.89
12	600426	华鲁恒升	3,506,594	108,529,084.30	1.87
13	002154	报喜鸟	16,875,500	107,496,935.00	1.85
14	600596	新安股份	5,873,689	104,081,769.08	1.79
15	000983	山西焦煤	11,814,950	98,182,234.50	1.69
16	603816	顾家家居	1,250,193	96,614,915.04	1.66
17	300144	宋城演艺	5,601,840	94,110,912.00	1.62
18	600048	保利地产	7,751,684	93,330,275.36	1.60
19	002044	美年健康	10,225,511	93,034,405.21	1.60
20	300271	华宇软件	4,607,599	88,696,280.75	1.53
21	600703	三安光电	2,728,651	87,453,264.55	1.50
22	600309	万华化学	712,661	77,551,770.02	1.33
23	300724	捷佳伟创	640,465	74,300,344.65	1.28
24	300409	道氏技术	3,042,400	72,348,272.00	1.24
25	002430	杭氧股份	2,024,536	70,028,700.24	1.20
26	600919	江苏银行	8,656,213	61,459,112.30	1.06

27	601128	常熟银行	9,693,630	60,100,506.00	1.03
28	603986	兆易创新	312,772	58,769,858.80	1.01
29	000568	泸州老窖	248,000	58,513,120.00	1.01
30	002185	华天科技	3,790,100	58,329,639.00	1.00
31	000009	中国宝安	3,136,000	57,294,720.00	0.99
32	605300	佳禾食品	2,045,190	56,856,282.00	0.98
33	002120	韵达股份	4,165,500	56,359,215.00	0.97
34	300408	三环集团	1,321,054	56,039,110.68	0.96
35	603260	合盛硅业	714,801	54,975,344.91	0.95
36	002402	和而泰	2,260,708	54,189,170.76	0.93
37	002444	巨星科技	1,579,272	53,821,589.76	0.93
38	688008	澜起科技	860,101	53,653,100.38	0.92
39	300034	钢研高纳	1,645,700	53,007,997.00	0.91
40	600690	海尔智家	2,021,002	52,364,161.82	0.90
41	000049	德赛电池	1,138,633	52,263,254.70	0.90
42	000001	平安银行	2,220,000	50,216,400.00	0.86
43	600038	中直股份	934,800	49,301,352.00	0.85
44	300567	精测电子	789,406	48,469,528.40	0.83
45	000902	新洋丰	2,943,275	46,003,388.25	0.79
46	002648	卫星石化	1,166,360	45,709,648.40	0.79
47	002555	三七互娱	1,871,200	44,946,224.00	0.77
48	300394	天孚通信	1,767,085	44,742,592.20	0.77
49	002913	奥士康	554,767	43,244,087.65	0.74
50	601888	中国中免	142,778	42,847,677.80	0.74
51	002614	奥佳华	1,887,430	42,712,540.90	0.73
52	605168	三人行	267,504	41,024,413.44	0.71
53	300785	值得买	424,929	40,368,255.00	0.69
54	688667	菱电电控	327,640	36,043,676.40	0.62
55	603566	普莱柯	1,204,400	27,460,320.00	0.47
56	300476	胜宏科技	1,245,452	27,213,126.20	0.47
57	688526	科前生物	691,314	25,039,393.08	0.43
58	300726	宏达电子	282,257	19,896,295.93	0.34
59	300257	开山股份	538,007	7,731,160.59	0.13
60	000785	居然之家	341,692	2,074,070.44	0.04
61	688617	惠泰医疗	1,673	624,430.52	0.01
62	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.01
63	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.01
64	688161	威高骨科	3,069	252,486.63	0.00
65	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.00
66	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
67	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.00
68	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00

69	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
70	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
71	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
72	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
73	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
74	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
75	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
76	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
77	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
78	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
79	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
80	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
81	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
82	300929	华骐环保	183	5,407.65	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	300059	东方财富	340,435,905.96	11.28
2	000651	格力电器	211,289,856.34	7.00
3	601857	中国石油	209,380,720.86	6.94
4	002402	和而泰	201,148,062.74	6.67
5	002938	鹏鼎控股	178,560,088.98	5.92
6	600703	三安光电	173,366,794.03	5.75
7	601899	紫金矿业	162,536,327.47	5.39
8	601636	旗滨集团	158,562,886.86	5.26
9	002415	海康威视	145,678,333.79	4.83
10	300115	长盈精密	136,473,165.49	4.52
11	600426	华鲁恒升	128,267,346.35	4.25
12	601939	建设银行	122,786,220.10	4.07
13	600690	海尔智家	120,084,171.80	3.98
14	600048	保利地产	110,607,011.25	3.67
15	000983	山西焦煤	108,712,434.05	3.60
16	600183	生益科技	103,283,795.75	3.42
17	300114	中航电测	100,588,868.11	3.33
18	603816	顾家家居	98,676,224.37	3.27
19	600596	新安股份	98,252,975.06	3.26
20	300207	欣旺达	97,328,794.60	3.23
21	300724	捷佳伟创	96,669,149.47	3.20
22	300144	宋城演艺	95,931,077.70	3.18
23	000001	平安银行	89,270,368.92	2.96

24	300271	华宇软件	84,613,347.21	2.80
25	000921	海信家电	83,583,688.74	2.77
26	002154	报喜鸟	80,486,283.11	2.67
27	601128	常熟银行	77,470,303.17	2.57
28	002001	新和成	76,422,673.35	2.53
29	600309	万华化学	75,159,259.71	2.49
30	600115	中国东航	74,884,981.54	2.48
31	002430	杭氧股份	73,059,075.57	2.42
32	002185	华天科技	72,730,511.41	2.41
33	600188	兖州煤业	72,450,237.54	2.40
34	603260	合盛硅业	66,418,027.79	2.20
35	000002	万科A	60,960,449.60	2.02
36	600029	南方航空	60,509,441.28	2.01
37	002291	星期六	60,444,649.61	2.00
38	300613	富瀚微	60,346,932.00	2.00

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	300413	芒果超媒	322,012,711.91	10.67
2	300059	东方财富	191,836,801.49	6.36
3	600060	海信视像	188,245,919.12	6.24
4	000002	万科A	170,916,902.91	5.66
5	601318	中国平安	158,719,759.29	5.26
6	002415	海康威视	158,709,050.09	5.26
7	002402	和而泰	150,869,184.49	5.00
8	688099	晶晨股份	141,681,724.65	4.70
9	002001	新和成	128,018,496.10	4.24
10	300144	宋城演艺	121,171,307.79	4.02
11	600703	三安光电	120,706,462.21	4.00
12	601939	建设银行	115,827,089.98	3.84
13	600754	锦江酒店	111,787,054.03	3.71
14	600690	海尔智家	110,521,985.87	3.66
15	300207	欣旺达	106,449,389.41	3.53
16	600183	生益科技	99,136,842.29	3.29
17	002555	三七互娱	89,906,195.85	2.98
18	603816	顾家家居	83,741,592.20	2.78
19	300759	康龙化成	82,824,824.89	2.75
20	600346	恒力石化	80,891,646.06	2.68
21	603444	吉比特	80,441,015.50	2.67
22	600188	兖州煤业	79,885,774.36	2.65

23	003022	联泓新科	79,132,754.52	2.62
24	600115	中国东航	76,037,733.99	2.52
25	002064	华峰化学	74,068,132.50	2.45
26	002254	泰和新材	68,000,840.80	2.25
27	300613	富瀚微	66,812,190.52	2.21
28	002291	星期六	66,251,916.98	2.20

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	7,511,823,319.32
卖出股票收入（成交）总额	5,957,434,894.49

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	3,815,669.10	0.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	191,520,000.00	3.29
	其中：政策性金融债	191,520,000.00	3.29
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）	98,215,561.60	1.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	293,551,230.70	5.05

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	190207	19 国开 07	1,400,000	140,840,000.00	2.42
2	123111	东财转 3	553,395	80,994,892.20	1.39
3	150209	15 国开 09	500,000	50,680,000.00	0.87
4	113047	旗滨转债	70,100	11,180,249.00	0.19
5	110079	杭银转债	38,920	4,431,820.40	0.08

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，中国石油天然气股份有限公司、鹏鼎控股（深圳）股份有限公司、深圳市长盈精密技术股份有限公司、国家开发银行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内受到公开谴责、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	1,195,745.13
2	应收证券清算款	15,346,330.51

3	应收股利	—
4	应收利息	1,121,163.66
5	应收申购款	101,591,080.88
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	119,254,320.18

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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（%）
217,348	11,792.13	791,374,262.57	30.88	1,771,620,924.12	69.12

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	陈美月	3,000,000.00	3.71
2	陈力	2,043,258.00	2.53
3	兴业银行股份有限公司-兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）	1,984,228.00	2.45
4	林红玉	1,832,305.00	2.27
5	刘立平	1,476,300.00	1.83
6	中信证券信养天欣 FOF 股票型养老金产品-中国工商银行股份有限公司	1,334,358.00	1.65
7	成汝翠	1,282,504.00	1.59

8	李宇辉	1,281,536.00	1.58
9	陆旭峰	1,213,236.00	1.50
10	林恩平	1,046,785.00	1.29

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	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	2,371,604.59	0.0925

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 5 月 6 日） 基金份额总额	2,022,398,091.00
本报告期期初基金份额总额	1,574,392,165.95
本报告期基金总申购份额	1,695,549,454.70
减：本报告期基金总赎回份额	706,946,433.96
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	2,562,995,186.69

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，本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	
银河证券	2	6,015,434,757.32	44.68%	4,074,088.43	44.94%	—
光大证券	2	4,554,580,707.33	33.83%	2,875,464.43	31.72%	—
兴业证券	2	1,466,892,628.99	10.90%	1,072,742.06	11.83%	—
瑞银证券	2	1,059,802,323.36	7.87%	775,034.74	8.55%	—
东兴证券	1	367,110,659.41	2.73%	268,467.79	2.96%	—
财富证券	1	—	—	—	—	—
长城证券	1	—	—	—	—	—
国海证券	1	—	—	—	—	—
九州证券	2	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券	1	—	—	—	—	—
野村证券	1	—	—	—	—	新增 1 个

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
银河证券	40,982,048.66	38.81%	-	-	-	-
光大证券	39,132,795.80	37.06%	-	-	-	-
兴业证券	25,483,894.54	24.13%	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
九州证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
野村证券	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、规定互联网站	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	中国证券报、规定互联网站	2021-02-10
3	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网站	2021-03-05
4	关于增加阳光人寿为旗下部分基金销售机构的公告	中国证券报、规定互联网站	2021-04-01
5	关于兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）暂停接受一百万元以上申购、转换转入申请的公告	中国证券报、规定互联网站	2021-06-01
6	关于兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）恢复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	中国证券报、规定互联网站	2021-06-16

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	中国证券报、规定互联网站	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	中国证券报、规定互联网站	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	中国证券报、规定互联网站	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、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》
- 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