

兴全社会价值三年持有期混合型证券投资 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：招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。

基金托管人招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	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	10
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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	50
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	50

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	50
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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金
基金简称	兴全社会价值三年持有混合
基金主代码	008378
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 26 日
基金管理人	兴证全球基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,968,597,103.87 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及其他品种的投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。 本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票，需承担汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特定风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨卫东	张燕
	联系电话	021-20398888	0755-83199084
	电子邮箱	yangwd@xqfunds.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4006780099, 021-38824536	95555
传真		021-20398858	0755-83195201
注册地址		上海市黄浦区金陵东路 368 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		201204	518040
法定代表人		杨华辉	缪建民

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	981,206,277.99
本期利润	536,935,315.38
加权平均基金份额本期利润	0.1809
本期加权平均净值利润率	9.52%
本期基金份额净值增长率	10.11%
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	2,219,977,496.61
期末可供分配基金份额利润	0.7478
期末基金资产净值	5,843,224,836.49
期末基金份额净值	1.9683
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	96.83%

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

阶段	份额净	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	0.75%	0.73%	-1.15%	0.58%	1.90%	0.15%
过去三个月	6.06%	0.86%	2.24%	0.70%	3.82%	0.16%
过去六个月	10.11%	1.23%	1.45%	0.94%	8.66%	0.29%
过去一年	59.36%	1.37%	16.83%	0.94%	42.53%	0.43%
自基金合同生效起至今	96.83%	1.48%	17.72%	1.03%	79.11%	0.45%

注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%。其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势，适合作为本基金境内股票投资业绩比较基准。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数，本基金选择该指数来衡量港股投资部分的绩效。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，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的比较基准。

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：

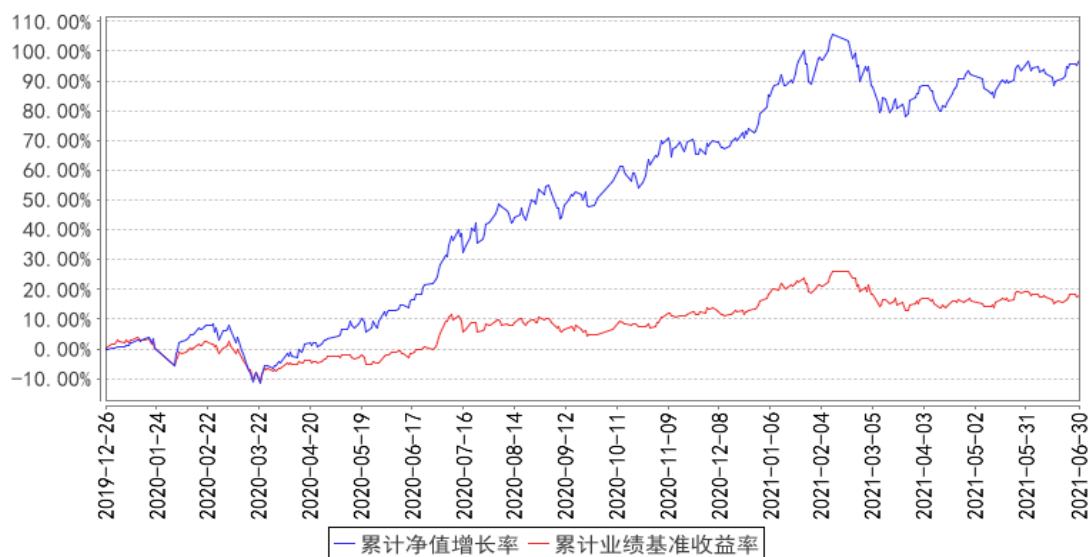
$$\text{Return}_t = 60\% \times (\text{沪深 300 指数收益率}_t / \text{沪深 300 指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{恒生指数收益率}_t / \text{恒生指数收益率}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中债综合（全价）指数收益率}_t / \text{中债综合（全价）指数收益率}_{t-1} - 1)$$

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

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

兴全社会价值三年持有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 06 月 30 日。

2、按照《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2019 年 12 月 26 日至 2020 年 6 月 25 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“兴证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		
谢治宇	总经理助理、基金管理部投资总监，兴全合润混合型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理	2019 年 12 月 26 日	-	13 年	硕士，2007 年加入兴证全球基金管理有限公司，历任行业研究员、专户投资部任投资经理、基金管理部投资副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，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、《兴全社会价值三年持有期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，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来，国内疫情仍然控制地较好，经济持续稳定恢复、稳中向好。海外部分国家受新冠疫情影响较大，发达国家疫苗接种相对较快，经济从疫情中有所恢复；但是新冠病毒不断突变，疫情影响恐将持续。货币政策方面，国内保持灵活精准、合理适度的稳健货币政策。美联储淡化通胀影响，其资产负债表仍处于扩张状态，美国 10 年期国债收益率 2 季度有所回落。

2021 年上半年上证指数上涨 3.40%，创业板指上涨 17.22%，港股恒生指数上涨 5.86%。开年之初，核心资产延续 20 年涨势，2-3 月份股市回调之后，以新能源汽车和半导体为代表的科技股逐渐表现强势。最终上半年基础化工、钢铁及电力设备新能源等行业表现较好，而非银金融、家电、军工等行业表现较差。

本基金报告期内股票仓位较为稳定，继续坚持自下而上精选个股的操作理念，持续关注具备核心竞争力的优秀公司，平衡好公司短期估值与长期价值，不断寻找具有良好投资性价比的优秀公司，力求为投资者带来稳健的回报。

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 1.9683 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.11%，业绩比较基准收益率为 1.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内宏观经济政策仍会着力保持经济运行在合理区间，经济高质量发展成果已

有所体现。海外方面，美联储开启 Taper 预期逐渐加强。在此背景下，我们仍将坚持自下而上精选个股的投资策略，选择具备核心竞争力的优秀公司，同时注重公司短期估值和长期投资价值的平衡，努力为持有人带来稳健的回报。

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》、《兴全社会价值三年持有期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，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

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：兴全社会价值三年持有期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	728,687,029.92	641,399,934.95
结算备付金		2,779,462.99	6,502,322.88
存出保证金		981,774.62	1,414,779.38
交易性金融资产	6.4.7.2	5,111,067,870.60	4,713,246,399.25
其中：股票投资		5,094,985,888.00	4,692,259,673.15
基金投资		—	—
债券投资		16,081,982.60	20,986,726.10
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		18,644,730.77	—
应收利息	6.4.7.5	87,230.18	69,721.45
应收股利		4,629,625.23	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		5,866,877,724.31	5,362,633,157.91
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 6 月 30 日	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		16,906,475.86	49,517,816.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,773,613.36	3,423,258.52
应付托管费		1,179,254.17	1,069,768.27
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,706,704.61	2,157,714.68
应交税费		59.37	79.03
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,780.45	175,000.00
负债合计		23,652,887.82	56,343,636.80
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,968,597,103.87	2,968,597,103.87
未分配利润	6.4.7.10	2,874,627,732.62	2,337,692,417.24
所有者权益合计		5,843,224,836.49	5,306,289,521.11
负债和所有者权益总计		5,866,877,724.31	5,362,633,157.91

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,968,597,103.87 份。基金份额净值(暂估业绩报酬前)1.9683 元，基金资产净值 5,843,224,836.49 元(暂估业绩报酬前)。暂估业绩报酬金额 502,936,468.08 元，基金资产净值(暂估业绩报酬后)5,340,288,368.41 元。其中，暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算，根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬，与最终计提的业绩报酬可能存在差异。

6.2 利润表

会计主体：兴全社会价值三年持有期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 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		575,338,757.95	714,138,376.93
1. 利息收入		1,317,028.65	2,955,086.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,305,910.36	873,310.61

债券利息收入		11,118.29	2,081,775.93
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）		1,018,292,691.91	163,354,267.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	982,041,549.88	140,871,679.84
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	606,404.08	-
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	35,644,737.95	22,482,587.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-444,270,962.61	547,829,022.92
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	-	-
减：二、费用		38,403,442.57	23,398,036.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,422,070.71	12,309,591.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,006,897.08	3,846,747.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	8,859,480.91	7,135,888.24
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		39.83	6.81
7. 其他费用	6.4.7.20	114,954.04	105,801.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		536,935,315.38	690,740,340.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		536,935,315.38	690,740,340.62

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴全社会价值三年持有期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）	2,968,597,103.87	2,337,692,417.24	5,306,289,521.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	536,935,315.38	536,935,315.38
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	2,968,597,103.87	2,874,627,732.62	5,843,224,836.49
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）	2,968,597,103.87	7,281,824.02	2,975,878,927.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	690,740,340.62	690,740,340.62
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）			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	2,968,597,103.87	698,022,164.64	3,666,619,268.51

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

兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金，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【2019】2332 号文批准，由基金管理人兴证全球基金管理有限公司向社会公开发行业募集，基金合同于 2019 年 12 月 26 日生效，首次募集规模为 2,968,597,103.87 份。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期。本基金的管理人及注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×20%+中债综合（全价）指数收益率×20%

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

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

本基金在本报告期间无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

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[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]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]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]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。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, 对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) 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	728,687,029.92
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	728,687,029.92

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	4,438,926,602.54	5,094,985,888.00	656,059,285.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	17,491,032.05	16,081,982.60
	银行间市场	-	-
	合计	17,491,032.05	16,081,982.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,456,417,634.59	5,111,067,870.60	654,650,236.01

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	62,142.20
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	9,925.63
应收债券利息	14,546.26
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	616.09
合计	87,230.18

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	1,706,704.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,706,704.61

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	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费用	27,273.08
预提信息披露费	59,507.37
合计	86,780.45

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	2,968,597,103.87	2,968,597,103.87
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
- 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	2,968,597,103.87	2,968,597,103.87

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	1,238,771,218.62	1,098,921,198.62	2,337,692,417.24
本期利润	981,206,277.99	-444,270,962.61	536,935,315.38
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,219,977,496.61	654,650,236.01	2,874,627,732.62

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	1,183,754.26
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	103,864.72
其他	18,291.38
合计	1,305,910.36

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	982,041,549.88
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	982,041,549.88

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	3,139,939,690.63
减：卖出股票成本总额	2,157,898,140.75
买卖股票差价收入	982,041,549.88

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	606,404.08
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	606,404.08

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	4,151,221.20
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,543,000.00
减：应收利息总额	1,817.12
买卖债券差价收入	606,404.08

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：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

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投资衍生工具。

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	35,644,737.95
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	35,644,737.95

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	-444,270,962.61
股票投资	-442,037,219.11
债券投资	-2,233,743.50
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	-444,270,962.61

6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

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	8,859,480.91
银行间市场交易费用	-
合计	8,859,480.91

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	-
银行费用	19,173.59
账户维护费用	9,000.00
合计	114,954.04

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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、基金注册登记机构、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	1,124,622,906.86	18.80	800,996,608.03	15.20

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

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	1,067,854.40	25.16	253,655.87	14.86
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	768,677.39	20.05	77,004.22	5.27
------	------------	-------	-----------	------

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用兴业证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从兴业证券获得证券研究综合服务。

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	22,422,070.71	12,309,591.98
其中：支付销售机构的客户维护费	9,875,468.57	7,273,450.80

注：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.80% 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×0.80%/当年天数。

本基金在业绩报酬结算日按照每笔基金份额分别计算业绩报酬，并对符合业绩报酬计提条件的基金份额逐笔计提业绩报酬。其中，业绩报酬结算日指投资者赎回申请日和本基金终止且财产最终清算日。投资者赎回申请日的业绩报酬结算日称为“赎回的业绩报酬结算日”，本基金终止且财产最终清算日的业绩报酬结算日称为“终止的业绩报酬结算日”。业绩报酬的计提基准：以本基金每笔份额业绩报酬计算期间的投资年化收益率（采用简单算术平均法计算）高于 8% 的部分为基准进行计提，计提比例为 20%。结算日是计算业绩报酬采用的净值日，提取日是结算日的下一工作日。

本基金逐笔计提业绩报酬，业绩报酬的计算方式如下：

1) 赎回的业绩报酬结算日的业绩报酬计算方式：

投资者赎回时，基金管理人按其赎回份额计算并提取业绩报酬，并遵循“先进先出”原则，计提的业绩报酬从赎回金额中扣减。

$$\text{每笔业绩报酬} = \max(S_i \times \text{NAV}_0 \times [(ANAV_1 - ANAV_0) / \text{NAV}_0 - 8\% \times T / 365] \times 20\%, 0)$$

S_i 为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额数量

NAV_0 为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额基金合同生效日或基金份额申购申请日的基金份额净值

$ANAV_0$ 为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额基金合同生效日或基金份额申购

申请日的基金份额累计净值

ANAV1 为赎回的业绩报酬结算日的基金份额累计净值

T 为赎回的业绩报酬结算日投资者申请赎回的每笔份额自基金合同生效日或基金份额申购确认日到本次业绩报酬提取日（不含）的实际运作天数

2) 终止的业绩报酬结算日的业绩报酬计算方式:

本基金终止且财产最终清算时, 基金管理人按每笔份额计算并提取业绩报酬, 计提的业绩报酬从相应确认金额中扣减。

每笔业绩报酬=MAX (Si×NAV0×[(ANAV1-ANAV0)/NAV0 -8%×T/365]×20%, 0)

Si 为终止的业绩报酬结算日投资者持有的每笔份额数量

NAV0 为终止的业绩报酬结算日投资者持有的每笔份额基金合同生效日或基金份额申购申请日的基金份额净值

ANAV0 为终止的业绩报酬结算日投资者持有的每笔份额基金合同生效日或基金份额申购申请日的基金份额累计净值

ANAV1 为终止的业绩报酬结算日的基金份额累计净值

T 为终止的业绩报酬结算日投资者持有的每笔份额自基金合同生效日或基金份额申购确认日到本次业绩报酬提取日（不含）的实际运作天数

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	7,006,897.08	3,846,747.53

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：本基金本报告期末与关联方通进行银行间同业市场债券（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：本基金本报告期末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。

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：本基金本报告期末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。

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（2019 年 12 月 26 日）持有的基金份额	17,495,867.97	17,495,867.97
报告期初持有的基金份额	17,495,867.97	17,495,867.97
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	17,495,867.97	17,495,867.97
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.5894%	0.5894%

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
招商银行	728,687,029.92	1,183,754.26	152,549,879.85	726,955.08

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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
002064	华峰化学	2020年2月4日	2022年2月7日	非公开发行流通受限	5.43	12.87	3,683,241	19,999,998.63	47,403,311.67	注 1
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	-
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	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	-

	复	日	日							
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	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	-

	技	日	日							
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	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	-

	份	日	日							
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	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	-

	技	日	日							
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	-
600754	锦江酒店	2021年3月23日	2021年9月22日	非公开发行流通受限	44.60	54.68	3,422,421	152,639,976.60	187,137,980.28	-
603486	科沃斯	2021年1月26日	2021年7月26日	大宗交易购入流通受限	109.37	222.09	350,000	38,279,500.00	77,731,500.00	-
603517	绝味食品	2020年12月31日	2021年7月1日	大宗交易购入流通受限	68.75	84.29	740,000	50,875,000.00	62,374,600.00	-
603816	顾家家居	2021年1月26日	2021年7月26日	大宗交易购入流通受限	71.09	75.26	110,000	7,819,900.00	8,278,600.00	-
603899	晨光文具	2021年1月15日	2021年7月15日	大宗交易购入流通受限	85.89	83.61	790,700	67,913,223.00	66,110,427.00	-
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	2021年6月	2022年1月	新股流通	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-

	再生	月 30 日	月 10 日	受限						
688169	石头科技	2021 年 3 月 1 日	2021 年 9 月 1 日	大宗 交易 购入 流通 受限	918.00	1,176.05	3,800	3,488,400.00	4,468,990.00	-
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	-
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	-
688621	阳光诺和	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 21 日	新股 流通 受限	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15	-
688625	呈和科技	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688681	科汇股份	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
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
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	-

注：1、公司证券简称自 2021 年 1 月 4 日起由“华峰氨纶”变更为“华峰化学”。

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
600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大事项停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	900,719	20,603,554.88	50,755,515.65	-

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：本基金本报告期末未持有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（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算）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（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算），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短期信用债券投资。

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	872,000.00	—
AAA 以下	15,209,982.60	20,986,726.10
未评级	—	—
合计	16,081,982.60	20,986,726.10

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

本基金每份基金份额的最短持有期为 3 年。对于每份基金份额，最短持有期指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金合同生效日或基金份额申购申请日起满 3 年（3 年指 365 天乘以 3 的自然天数，下同）后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 3 年内无法赎回的风险。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	728,687,029.92	-	-	-	-	-	728,687,029.92
结算备付金	2,779,462.99	-	-	-	-	-	2,779,462.99
存出保证金	981,774.62	-	-	-	-	-	981,774.62
交易性金融资产	-	-	-	-	16,081,982.60	5,094,985,888.00	5,111,067,870.60
应收利息	-	-	-	-	-	87,230.18	87,230.18
应收股利	-	-	-	-	-	4,629,625.23	4,629,625.23
应收证券清算款	-	-	-	-	-	18,644,730.77	18,644,730.77
资产总计	732,448,267.53	-	-	-	16,081,982.60	5,118,347,474.18	5,866,877,724.31
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,773,613.36	3,773,613.36
应付托管费	-	-	-	-	-	1,179,254.17	1,179,254.17
应付证券清算款	-	-	-	-	-	16,906,475.86	16,906,475.86
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,706,704.61	1,706,704.61
应交税费	-	-	-	-	-	59.37	59.37
其他负债	-	-	-	-	-	86,780.45	86,780.45
负债总计	-	-	-	-	-	23,652,887.82	23,652,887.82
利率敏感度缺口	732,448,267.53	-	-	-	16,081,982.60	5,094,694,586.36	5,843,224,836.49
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	641,399,934.95	-	-	-	-	-	641,399,934.95
结算备付金	6,502,322.88	-	-	-	-	-	6,502,322.88
存出保证金	1,414,779.3	-	-	-	-	-	1,414,779.3

	8						38
交易性金融资产	—	—	—	—	20,986,726.10	4,692,259,673.15	4,713,246,399.25
应收利息	—	—	—	—	—	69,721.45	69,721.45
资产总计	649,317,037.21	—	—	—	20,986,726.10	4,692,329,394.60	5,362,633,157.91
负债							
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	3,423,258.52	3,423,258.52
应付托管费	—	—	—	—	—	1,069,768.27	1,069,768.27
应付证券清算款	—	—	—	—	—	49,517,816.30	49,517,816.30
应付交易费用	—	—	—	—	—	2,157,714.68	2,157,714.68
应交税费	—	—	—	—	—	79.03	79.03
其他负债	—	—	—	—	—	175,000.00	175,000.00
负债总计	—	—	—	—	—	56,343,636.80	56,343,636.80
利率敏感度缺口	649,317,037.21	—	—	—	20,986,726.10	4,635,985,757.80	5,306,289,521.11

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

注：本期末及上年度末，市场利率对基金资产净值均无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,325,530,757.70	-	1,325,530,757.70
资产合计	-	1,325,530,757.70	-	1,325,530,757.70
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,325,530,757.70	-	1,325,530,757.70
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,358,813,839.76	-	1,358,813,839.76
资产合计	-	1,358,813,839.76	-	1,358,813,839.76
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,358,813,839.76	-	1,358,813,839.76

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变。		
	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	所有外币相对人民	66,276,537.89	67,940,691.99

	币升值 5%		
	所有外币相对人民币贬值 5%	-66,276,537.89	-67,940,691.99

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。

本基金投资组合比例为：投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0—50%）；每个交易日日终在扣除股指期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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	5,094,985,888.00	87.19	4,692,259,673.15	88.43
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	16,081,982.60	0.28	20,986,726.10	0.40
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	5,111,067,870.60	87.47	4,713,246,399.25	88.82

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		
	本基金业绩比较基准变化 10%，其他变量不变		
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）
	1. 业绩比较基准上升 10%	708,146,211.99	626,931,576.16
	2. 业绩比较基准下降 10%	-708,146,211.99	-626,931,576.16

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	5,094,985,888.00	86.84
	其中：股票	5,094,985,888.00	86.84
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	16,081,982.60	0.27
	其中：债券	16,081,982.60	0.27
	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	731,466,492.91	12.47

8	其他各项资产	24,343,360.80	0.41
9	合计	5,866,877,724.31	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,325,530,757.70 元，占净值比例 22.68%。

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	—	—
C	制造业	2,582,408,546.84	44.19
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	9,933,677.16	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	58,010,118.54	0.99
H	住宿和餐饮业	239,826,981.28	4.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	402,663,068.05	6.89
J	金融业	316,440,745.35	5.42
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	134,243,395.83	2.30
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	25,857,192.20	0.44
S	综合	—	—
	合计	3,769,455,130.30	64.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	—	—
非日常生活消费品	289,475,037.85	4.95
日常消费品	172,270,807.77	2.95
能源	—	—
金融	42,486,004.80	0.73
医疗保健	267,881,186.50	4.58
工业	—	—
信息技术	208,568,731.55	3.57

通信服务	311,531,291.19	5.33
公用事业	-	-
房地产	33,317,698.04	0.57
合计	1,325,530,757.70	22.68

注：以上分类采用全球行业分类标准（Global Industry Classification Standard, GICS）。

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	600690	海尔智家	10,988,207	284,704,443.37	4.87
1	06690	海尔智家	3,561,859	80,317,669.36	1.37
2	00700	腾讯控股	641,097	311,531,291.19	5.33
3	002415	海康威视	4,378,894	282,438,663.00	4.83
4	600754	锦江酒店	4,347,601	239,826,981.28	4.10
5	688099	晶晨股份	1,930,531	216,605,578.20	3.71
6	600309	万华化学	1,730,516	188,314,751.12	3.22
7	000001	平安银行	8,062,895	182,382,684.90	3.12
8	00291	华润啤酒	2,945,152	170,929,494.81	2.93
9	02382	舜宇光学科技	682,500	139,361,334.84	2.39
10	600031	三一重工	4,713,862	137,031,968.34	2.35
11	601166	兴业银行	6,521,817	134,023,339.35	2.29
12	603259	药明康德	855,821	134,013,010.39	2.29
13	603816	顾家家居	1,484,042	114,464,565.76	1.96
14	600521	华海药业	5,293,019	110,518,236.72	1.89
15	06078	海吉亚医疗	1,299,612	110,300,877.60	1.89
16	00175	吉利汽车	5,177,000	105,322,731.01	1.80
17	00780	同程艺龙	6,419,200	103,834,637.48	1.78
18	600315	上海家化	1,668,800	100,361,632.00	1.72
19	603707	健友股份	2,329,373	97,251,322.75	1.66
20	002938	鹏鼎控股	2,686,908	96,406,259.04	1.65
21	000895	双汇发展	2,969,875	94,442,025.00	1.62
22	000739	普洛药业	3,192,988	93,873,847.20	1.61
23	01801	信达生物	1,192,000	89,811,054.05	1.54
24	603517	绝味食品	1,064,910	89,761,263.90	1.54
25	002390	信邦制药	8,126,550	85,166,244.00	1.46
26	300327	中颖电子	940,310	80,142,621.30	1.37
27	600426	华鲁恒升	2,528,886	78,269,021.70	1.34
28	603486	科沃斯	350,000	77,731,500.00	1.33
29	002212	天融信	3,727,735	73,697,320.95	1.26
30	002555	三七互娱	3,028,236	72,738,228.72	1.24
31	300124	汇川技术	914,071	67,878,912.46	1.16

32	603899	晨光文具	790,700	66,110,427.00	1.13
33	02018	瑞声科技	1,290,000	62,363,563.92	1.07
34	002120	韵达股份	4,287,518	58,010,118.54	0.99
35	600873	梅花生物	10,057,000	56,319,200.00	0.96
36	002250	联化科技	1,984,341	55,363,113.90	0.95
37	002332	仙琚制药	4,404,217	55,228,881.18	0.95
38	600460	士兰微	900,719	50,755,515.65	0.87
39	002614	奥佳华	2,118,732	47,946,905.16	0.82
40	002064	华峰化学	3,683,241	47,403,311.67	0.81
41	00998	中信银行	13,875,000	42,486,004.80	0.73
42	06855	亚盛医药-B	1,008,800	39,451,908.29	0.68
43	002603	以岭药业	1,276,800	37,231,488.00	0.64
44	688690	纳微科技	305,326	35,875,805.00	0.61
45	06049	保利物业	759,800	33,317,698.04	0.57
46	01530	三生制药	3,545,000	28,317,346.56	0.48
47	300413	芒果超媒	376,927	25,857,192.20	0.44
48	603444	吉比特	45,200	23,956,000.00	0.41
49	603195	公牛集团	104,568	21,122,736.00	0.36
50	688065	凯赛生物	197,578	20,723,956.42	0.35
51	000785	居然之家	1,583,834	9,613,872.38	0.16
52	688083	中望软件	14,704	8,069,179.06	0.14
53	300451	创业慧康	800,397	7,075,509.48	0.12
54	00968	信义光能	490,000	6,833,373.79	0.12
55	688169	石头科技	3,800	4,468,990.00	0.08
56	00322	康师傅控股	104,000	1,341,312.96	0.02
57	688819	天能股份	28,382	1,240,009.58	0.02
58	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.02
59	300999	金龙鱼	12,114	1,029,205.44	0.02
60	300785	值得买	5,000	475,000.00	0.01
61	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
62	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
63	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
64	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.00
65	688131	皓元医药	391	135,360.29	0.00
66	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
67	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.00
68	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
69	688636	智明达	918	97,583.40	0.00
70	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.00
71	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
72	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.00
73	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00

74	300894	火星人	679	46,172.00	0.00
75	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
76	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
77	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
78	688517	金冠电气	2,892	34,356.96	0.00
79	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
80	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
81	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
82	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
83	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
84	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
85	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
86	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
87	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
88	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
89	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
90	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
91	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
92	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
93	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
94	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
95	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
96	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
97	01347	华虹半导体	293	10,459.00	0.00
98	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
99	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
100	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
101	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
102	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
103	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
104	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
105	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
106	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
107	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
108	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
109	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
110	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
111	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
112	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
113	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
114	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
115	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00

116	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
117	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
118	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
119	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
120	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
121	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
122	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
123	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
124	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
125	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
126	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
127	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
128	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
129	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
130	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	000001	平安银行	201,534,624.28	3.80
2	600309	万华化学	185,431,552.80	3.49
3	600754	锦江酒店	170,601,621.60	3.22
4	00700	腾讯控股	167,039,100.64	3.15
5	002415	海康威视	159,219,642.21	3.00
6	601166	兴业银行	156,456,655.05	2.95
7	002938	鹏鼎控股	124,534,664.58	2.35
8	02382	舜宇光学科技	111,245,491.93	2.10
9	00175	吉利汽车	110,998,879.53	2.09
10	600690	海尔智家	109,075,122.05	2.06
11	600315	上海家化	78,826,332.40	1.49
12	603899	晨光文具	67,913,223.00	1.28
13	601601	中国太保	66,488,010.38	1.25
14	600873	梅花生物	62,984,238.83	1.19
15	600521	华海药业	61,717,703.06	1.16
16	01398	工商银行	57,802,704.15	1.09
17	00291	华润啤酒	57,492,476.92	1.08
18	002250	联化科技	54,513,756.24	1.03
19	02018	瑞声科技	54,337,457.32	1.02

20	603486	科沃斯	50,693,720.95	0.96
----	--------	-----	---------------	------

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	600309	万华化学	246,049,960.71	4.64
2	01211	比亚迪股份	189,173,834.27	3.57
3	603486	科沃斯	188,886,943.43	3.56
4	601012	隆基股份	173,173,730.90	3.26
5	601318	中国平安	146,000,121.72	2.75
6	600031	三一重工	142,175,984.55	2.68
7	00700	腾讯控股	111,470,981.65	2.10
8	02269	药明生物	106,338,595.47	2.00
9	03690	美团-W	97,081,244.44	1.83
10	601799	星宇股份	93,826,823.34	1.77
11	600460	士兰微	80,481,656.18	1.52
12	002821	凯莱英	75,426,480.50	1.42
13	600426	华鲁恒升	72,178,368.16	1.36
14	000333	美的集团	68,430,390.52	1.29
15	03323	中国建材	67,656,534.34	1.28
16	02238	广汽集团	64,944,509.90	1.22
17	300124	汇川技术	63,772,892.64	1.20
18	601601	中国太保	61,145,861.99	1.15
19	688036	传音控股	59,509,802.58	1.12
20	002064	华峰化学	58,617,657.95	1.10

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

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	3,002,661,574.71
卖出股票收入（成交）总额	3,139,939,690.63

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）	16,081,982.60	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,081,982.60	0.28

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	127024	盈峰转债	138,260	15,209,982.60	0.26
2	113050	南银转债	8,720	872,000.00	0.01

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：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

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：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，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，腾讯控股有限公司、平安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	981,774.62
2	应收证券清算款	18,644,730.77
3	应收股利	4,629,625.23
4	应收利息	87,230.18
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	24,343,360.80

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	127024	盈峰转债	15,209,982.60	0.26

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600754	锦江酒店	187,137,980.28	3.20	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

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（%）
68,629	43,255.72	163,690,234.37	5.51	2,804,906,869.50	94.49

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	10,701,139.04	0.3605

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 12 月 26 日）基金份额总额	2,968,597,103.87
本报告期期初基金份额总额	2,968,597,103.87
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
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	2,968,597,103.87

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	1,124,622,906.86	18.80%	1,067,854.40	25.16%	-
东方财富证券	2	839,956,455.04	14.04%	385,482.61	9.08%	-
广发证券	4	672,589,624.97	11.24%	485,081.98	11.43%	-
国金证券	2	661,560,207.62	11.06%	441,983.71	10.41%	-
中信证券	7	526,448,689.86	8.80%	359,553.69	8.47%	新增部分席位
东方证券	1	434,758,528.78	7.27%	317,939.78	7.49%	-
中信建投证券	5	400,949,860.70	6.70%	272,383.87	6.42%	-

中金公司	2	368,978,389.25	6.17%	245,436.34	5.78%	—
华创证券	1	224,340,302.14	3.75%	164,062.67	3.87%	—
国泰君安	2	197,057,388.91	3.29%	152,181.46	3.59%	—
长江证券	2	150,630,249.33	2.52%	96,598.44	2.28%	—
中泰证券	4	141,896,811.39	2.37%	89,579.22	2.11%	—
东吴证券	2	79,653,231.64	1.33%	50,284.72	1.18%	—
银河证券	1	69,887,724.46	1.17%	51,107.44	1.20%	—
国信证券	2	53,991,425.36	0.90%	40,212.62	0.95%	—
招商证券	2	29,567,908.73	0.49%	21,621.36	0.51%	—
安信证券	2	4,618,960.88	0.08%	3,377.84	0.08%	—
渤海证券	1	—	—	—	—	—
德邦证券	2	—	—	—	—	—
国都证券	2	—	—	—	—	—
国盛证券	2	—	—	—	—	—
华福证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	2	—	—	—	—	—
华西证券	2	—	—	—	—	—
民生证券	1	—	—	—	—	—
南京证券	1	—	—	—	—	—
太平洋证 券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
万联证券	1	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
中金财富 证券	4	—	—	—	—	—
申万宏源 证券	2	—	—	—	—	新增
摩根大通	2	—	—	—	—	新增

证券						
----	--	--	--	--	--	--

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	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,151,221.20	100.00%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

南京证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通 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	上海证券报及规定互联 网网站	2021-02-09
2	关于增加中原证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-03-05
3	关于旗下部分基金投资锦江酒店(600754)非公开发行的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-03-25
4	关于增加中金财富证券为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-04-07
5	关于增加珠海盈米基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-05-17
6	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	上海证券报及规定互联 网网站	2021-05-19

§ 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

本基金每份基金份额的最短持有期为 3 年。本基金每份基金份额在其最短持有期到期日（含该日）后，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。因此，对于基金份额持有人而言，存在投资本基金后 3 年内无法赎回的风险。

本基金为逐笔计提业绩报酬的基金，由于管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回金额可能低于按对应的赎回份额及赎回申请日基金份额净值计算的赎回金额，投资者实际赎回金额以登记机构确认数据为准。基金管理人在指定网站等媒介每日披露的基金份额净值为未扣除业绩报酬的基金份额净值。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金的法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

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